

上海证券交易所债券业务指南

（商业银行专用）

二〇一〇年十一月

目 录

一、资格准入流程	3
二、通信线路开通流程	14
三、报盘系统及技术支持	33
四、债券发行、交易业务指引	59
五、规则汇编	62
六、收费标准	103
七、业务联系方式	103

一、 资格准入流程

上市商业银行申请参与我所债券交易试点资格指南

一、 基本条件

上市商业银行申请参与本所债券市场业务，必须满足以下条件：

1、符合《关于上市商业银行在证券交易所参与债券交易试点有关问题的通知》（证监发[2010]91号）要求；

2、有专职部门和人员负责债券业务；

3、有专门的债券业务管理信息系统，符合本所对技术风险防范提出的各项管理要求；

4、本所要求的其他条件。

二、 资格申请

1、 申请

上市商业银行申请参与本所债券市场业务，需向本所会员部提交以下材料：

(1) 申请书（详见附件1）；

(2) 基本信息登记表（详见附件2）；

(3) 金融业务许可证、企业法人营业执照；

(4) 专职部门及主要管理人员；

(5) 本所要求提交的其他文件。

2、 受理、审核与反馈

上市商业银行或其分行申请文件齐备的，本所会员部予以受理，本所自受理之日起五个工作日内做出是否同意的决定。

本所同意上市商业银行参与本所债券市场业务的，出具《关于同意 XX 银行参与本所债券市场业务的函》。

3、 本所会员部专人负责受理

联系人：章玲、池钺庭；

联系电话：021-68805896、68800040；

传真：021-58878718；

电子邮件：lzhang@sse.com.cn、ctchi@sse.com.cn

三、交易开通

1、申请数字证书

本所业务流程通过本所外部网站采用电子方式实现，上市商业银行办理业务流程比照会员，应先向本所申请会员专区用户 EKEY。

申请 EKEY 时，应向本所会员部提交《“会员公司专区”用户 EKEY 及权限申请表》（附件 3），上市商业银行应确保至少有两个 EKEY 专用于相关业务办理。

2、机构新设登记

使用 EKEY 登陆本所外部网，选择非会员机构新设登记即可以进入办理栏目。

具体流程如下：

（1）业务办理流程：



（2）非会员登记申请材料：

- Ⅰ 主管机关同意公司设立的批复
- Ⅰ 公司金融许可证
- Ⅰ 工商执照
- Ⅰ 资格申请报告
- Ⅰ 专职部门及主要管理人员概况
- Ⅰ 公司章程及内控制度
- Ⅰ 非会员机构基本情况登记表
- Ⅰ 公司主要职能部门登记表

（3）相关页面：

选择“非会员机构新设登记”业务办理后，进入业务说明页

→ 非会员机构新设登记

非会员机构新设登记的办理流程如下图所示：



通过网上申请非会员机构新设登记前，您必须准备好以下材料，若已经准备好所有材料，请按“现在申请”按钮开始网上申请。

(带 * 为必须提交的材料或必须填写的内容)

非会员机构新设登记

- ▶ 主管机关同意公司设立的批复 (tif, jpg格式扫描文件, 请以200dpi, 黑白精度扫描) *
- ▶ 公司金融许可证 (tif, jpg格式扫描文件, 请以200dpi, 黑白精度扫描) *
- ▶ 工商执照 (tif, jpg格式扫描文件, 请以200dpi, 黑白精度扫描) *
- ▶ 资格申请报告(承诺遵守本所业务规则并接受本所监管) (电子文档, txt, doc, jpg, tiff格式文件) *
- ▶ 专职部门及主要管理人员概况 (电子文档, txt, doc, jpg, tiff格式文件) *
- ▶ 公司章程及内控制度 (电子文档, txt, doc, jpg, tiff格式文件) *
- ▶ 非会员机构基本情况登记表 *
- ▶ 公司主要职能部门登记表 *

现在申请

点“现在申请”，

→ 非会员机构新设登记

1 申请材料递交 → 2 非会员机构基本情况登记表 → 3 公司主要职能部门登记表

您本次业务的流水号是:17232

主管机关同意公司设立的批复		(tif, jpg格式扫描文件, 请以200dpi, 黑白精度扫描, pdf文件)	
批复上传*	C:\Documents and Settings\Administrator\My Docu	浏览...	查看
批复的标题*	111		
批复的文号*	111		
批复的发文日期*	2006-02-01	(YYYY-MM-DD)	

金融许可证		(tif, jpg格式扫描文件, 请以200dpi, 黑白精度扫描, pdf文件)	
金融许可证上传*	C:\Documents and Settings\Administrator\My Docu	浏览...	查看
金融业务许可证号*	111		

工商执照		(tif, jpg格式扫描文件, 请以200dpi, 黑白精度扫描, pdf文件)	
工商执照上传*	C:\Documents and Settings\Administrator\My Docu	浏览...	查看
企业法人营业执照号*	111		

资格申请报告		(电子文档)	
资格申请报告(承诺遵守本所业务规则并接受本所监管)*	C:\Documents and Settings\Administrator\My Docu	浏览...	查看

专职部门及主要管理人员概况		(电子文档)	
专职部门及主要管理人员概况上传*	C:\Documents and Settings\Administrator\My Docu	浏览...	查看

公司章程		(电子文档)	
公司章程上传*	C:\Documents and Settings\Administrator\My Docu	浏览...	查看

公司内控制度		(电子文档)	
公司内控制度上传*	C:\Documents and Settings\Administrator\My Docu	浏览...	查看

下一步

选择下一步，分别填写非会员机构基本情况表和公司主要职能登记表，进

行提交。

3、席位受让

上市商业银行参与本所债券市场业务，须持有一个本所席位。已持有本所席位的上市商业银行，可直进入下一步骤。未持有本所席位的上市商业银行，可通过市场受让席位，本所原则上不新增设席位。席位转让流程由受让方发起，转让方协助确认，使用 EKEY 登陆本所外部网，选择席位转让即可以进入办理栏目，具体流程如下：

(1) 席位转让的办理流程：



(2) 申请材料：

席位转让协议

(3) 相关页面：

选择“席位转让”业务办理后，进入业务说明页

→ 席位转让

席位转让的办理流程如下图所示：



通过网上申请席位转让前，您必须准备好以下材料，若已经准备好所有材料，请按“现在申请”按钮开始网上申请。

(带 * 为必须提交的材料或必须填写的内容)

席位转让

- 席位转让协议 (tif,jpg格式扫描文件,请以200dpi,黑白精度扫描)
- 席位转让登记表 *

现在申请

查看帮助

选择“现在申请”后，进入申请材料递交，

→ 席位转让

1 申请材料递交 → 2 交易单元转让登记表 → 3 交易单元开通申请表

您本次业务的流水号是:21281

请输入以下席位转让申请材料,带 * 为必填项

会员间席位转让协议(加盖公章)		(tif, jpg格式扫描文件, 请以200dpi, 黑白精度扫描, 或者pdf文件)	
转让协议上传 *	<input type="text" value="a.jpg"/>	<input type="button" value="浏览..."/>	<input type="button" value="上传"/>
其他上传材料		(tif, jpg格式扫描文件或者word、pdf文件)	
其他上传材料上传	<input type="text"/>	<input type="button" value="浏览..."/>	<input type="button" value="上传"/>

下一步

提交材料后, 进入席位转让信息填报,

→ 席位转让

1 申请材料递交 → 2 席位转让登记表

您本次业务的流水号是:24452

席位转让登记表 - 受让方填写		(带 * 为必填项)
原属会员名称 *	<input type="text"/>	<input type="button" value="选择会员"/>
席位号 *	<input type="text"/>	<input type="button" value="选择席位"/>
席位转让登记表 - 出让方填写		(带 * 为必填项)
确认出让席位号	<input type="text"/>	

当你公司交易单元(PBU)数量超过你公司交易席位数量时,会引起PBU使用费的增加。《上海证券交易所会员业务网上办理指引》1.5费用计收对交易单元使用费的收取作了如下规定:

会员拥有的每个席位可抵免一个交易单元的使用费。对超出其席位数量的部分,本所收取每个交易单元每年5万元的交易单元使用费。此项费用按月计算,按年收取;交易单元当月开通使用,当月计费;当月撤销,下月停止计费。交易单元用于代办股份转让、固定收益类产品、ETF数据传输的,暂时免收使用费。

上一步

下一步

点击下一步,

→ 席位转让

您本次业务的流水号是:2128

您的业务:海通证券股份有限公司的受让海通证券的13004席位,已经填写完成。

若您对以上办理内容确认,则现在可以:

点击“提醒对方”按钮提醒出让方协助填写您的申请材料;

点击“上一步”按钮回到上一页;

提醒出让方办理。

出让方协助办理业务,只需要填写下转让的席位号

→ 席位转让

1 申请材料递交 → 2 席位转让登记表

您本次业务的流水号是:17279

席位转让登记表 - 受让方填写		(带 * 为必填项)
原属会员名称 *	<input type="text" value="海通证券"/>	
席位号 *	<input type="text" value="107"/>	

席位转让登记表 - 出让方填写		(带 * 为必填项)
确认出让席位号 *	<input type="text"/>	

当你公司交易单元（PBU）数量超过你公司交易席位数量时，会引起PBU使用费的增加。《上海证券交易所会籍业务网上办理指引》1.5费用计收对交易单元使用费的收取作了如下规定：

会员拥有的每个席位可抵免一个交易单元的使用费。对超出其席位数量的部分，本所收取每个交易单元每年5万元的交易单元使用费。此项费用按月计算，按年收取；交易单元当月开通使用，当月计费；当月撤销，下月停止计费。交易单元用于代办股份转让、固定收益类产品、ETF数据传输的，暂时免收使用费。

[显示交易单元转让协议](#)

查看协议后，选择提交，业务协助办理结束。

受让方提交，业务办理结束。

4、新设债券专用交易单元

新设交易单位前，先电话联系本所会员部，确认交易单元号；然后使用 EKEY 登陆本所外部网，选择非会员机构新设债券交易单元即可以进入办理栏目；设立交易单元后，上市商业银行即可参与本所债券市场业务。具体流程如下：

1) 业务办理流程：



2) 非会员机构新设债券交易单元申请材料：

- | 新设交易单元申请报告
- | 非会员机构交易单元登记表
- | 非会员机构交易单元联通申请表

3) 相关页面：

选择“非会员机构新设债券交易单元”业务办理后，进入业务说明页

非会员机构新设债券专用交易单元

非会员机构新设债券专用交易单元的办理流程如下图所示：



通过网上申请非会员机构新设债券专用交易单元前，您必须准备好以下材料，若已经准备好所有材料，请按“现在申请”按钮开始网上申请。

(带 * 为必须提交的材料系必须填写的内容)

非会员机构新设债券专用交易单元

- * 新设交易单元申请表 (电子文档) (格式见附件)
- * 非会员机构交易单元登记表
- * 非会员机构交易单元联通申请表

常见问题

问题 1：交易单元新设业务中的交易单元号码是怎样的？

答：交易单元新设业务中，①交易单元号为“8”开头的五位数，②交易单元号为“非8”开头的五位数。

问题 2：交易单元新设业务中的交易单元号码与问题 1 不符如何处理？

答：如会员单位在业务办理系统中发现新设交易单元号码不符合问题的解答，会员单位须与上证所会员联络人取得联系后更改。

问题 3：上海证券交易所对会员单位的交易单元管理有哪些方面的要求？

答：根据《信息安全等级保护——接入交易所基本要求》，会员单位对交易单元的管理必须满足如下要求：

- 1、会员对交易单元业务应有专门的人员、场地、设备、档案管理及完整的规章制度。
- 2、会员对交易单元管理技术管理必须分离，应合理规划、配置交易单元的联通关系及应用。
- 3、会员单位必须对交易单元操作员密码和密码保管，做好备份，专人负责。

问题 4：会员单位新设交易单元后，操作员和密码如何取得？

答：新设交易单元的操作员和密码将显示在提交流程的确认页。

问题 5：会员单位在交易单元相关的操作员和密码后如何变更？

答：会员单位如需变更交易单元操作员和密码的，须提供申请表，加盖公司章，并在申请表中留下联系人、联系电话、手机，传真至 021-66007170-96 线，待审核人员回复。

现在申请

查看帮助

选择“现在申请”

非会员机构新设债券专用交易单元



您本次申请的流水号是 433718

本业务办理流程有 1444 笔业务正在等待上海证券交易所各业务部门审核处理，贵公司提交的本次业务办理可在 60 个工作日内（仅供参考）完成。请输入以下申请材料，* 为必填项

新设交易单元申请表	(电子文档)
新设交易单元申请表 * 格式	C:\Documents and Settings\Administrator\My Documents [浏览...]

下一步

选择“下一步”

非会员机构新设债券专用交易单元



您本次申请的流水号是 433718

非会员机构交易单元登记表	(带 * 为必填项)	
交易单元号 *	12333	可达交易单元号
会员单位标识广卫标识码 * 格式	1.1.1.1	
会员单位标识广小新设代码 * 格式	1111	

提示：如果宽厂卫卫标识码无请填写 200.200.200.200，宽厂小新设代码请填写 0000

上一步 下一步

选择“下一步”

非会员机构新设债券专用交易单元



您本次申请的流水号是 433718

非会员机构交易单元联通申请表	(带 * 为必填项)	
交易单元号 *	12333	总联交易单元
申请联通交易单元号 *	12333	选择交易单元 新增交易单元
备注		

必填的姓无姓台必填项 并可在备注栏内填写备注。

上一步 下一步

填写好联通表后，选择“下一步”

您的姓名：中国光大银行总行公司管理部，会员机构新增的12375债券专用交易单元名称，已经填写完成。

新设交易单元操作手机号码/交易单元号+000001,为12333888001，初始密码为11111111，新设流程完成之后，请及时更改密码，并做好密码管理工作。

请您对以上办理内容确认，确认后可以：

点击“提交”按钮直接提交给所有中国材料到上海证券交易所审核；

提交

点击“上一步”按钮返回上一页；

上一步

选择业务提交，结束业务办理。

5、交易单元使用管理。

关于债券专用交易单位的相关费用，本所参照会员交易单位相关费用收取。上市商业银行根据需要可以办理债券交易单元注销、停用与恢复使用等相关流程。

四、日常管理

1、上市商业银行应当分别设业务代表一名，业务联络人两名，组织、协调与本所的各项业务往来。业务代表由主管债券业务的部门负责人担任。

2、上市商业银行应当遵守本所有关技术规定，参加本所安排的有关技术测试，完成本所相关的技术升级工作。交易相关的技术系统要求，比照会员执行。

3、上市商业银行应当根据本所要求，每年就其参与本所债券市场的交易情况提交书面报告。

4、上市商业银行发生下列情形之一的，应当自该情形发生之日起五个工作日内向本所提交书面报告：

- (1) 章程、注册资本或注册地址变更；
- (2) 高级管理人员、业务代表、业务联系人发生变动；
- (3) 发生重大财务危机；
- (4) 因违法、违规行为受到其主管部门或行业协会处罚；
- (5) 本所规定的其他事项。

5、上市商业银行应当遵守本所业务规则，接受本所自律管理。违反本所业务规则，本所以对上市商业银行采取监管措施、纪律处分的，比照会员执行。

五、其他

- 1、本指南由本所负责解释。
- 2、本指南自发布之日起施行。

附件 1

上市商业银行申请书

上海证券交易所:

经本公司研究决定，特向贵所申请参与债券市场业务，现提交下列申请材料，请审核并批准：

- 1、本申请书；
- 2、基本信息登记表；
- 3、有关批复文件。

在此，公司郑重承诺：

一、遵守法律、法规、规章、上海证券交易所相关业务规则，依法参与上海证券交易所债券市场业务。

二、诚实信用，自觉遵守商业道德，维护上海证券交易所债券市场秩序。

三、接受上海证券交易所自律管理。

四、如违反法律、法规、规章、上海证券交易所相关业务规则，接受上海证券交易所作出的包括但不限于暂停或限制参与债券市场业务等决定，并由此承担一切法律责任。

申请人： （签章）
年 月 日

附件 2

基本信息登记表

公司全称:				邮编:		
公司地址:			电话:	传真:		
企业法人营业执照号:			注册资本:			
法定代表人:			总经理:			
业务代表	部门	职务	电话	手机	传真	E-mail
业务联络人	部门	职务	电话	手机	传真	E-mail

(公司盖章)
年 月 日

附件 3

会员专区用户 EKEY 及权限申请表

“会员公司专区”用户 EKEY 及权限申请表

上海证券交易所：

因业务办理需要，现特向贵所申请数字证书并向本公司的 EKEY 使用 www.sse.com.cn 网站上会员专区的以下业务办理权限：

数字证书新增（ 新增 不需新增）*见附注

办理权限：

会籍业务（类型： 新增 删除）

大宗交易系统专场业务合格投资者申请 A 类 / B 类 / C 类

（类型： 新增 删除）

融资融券业务（类型： 新增 删除）

其他 _____（类型： 新增 删除）

I 用户名称：_____

Ekey Ca_Id: _____

* 一个 EKEY 申请对应一张权限申请表；新申请 EKEY 的 Ca_Id，申请人无需填写。

申请单位：

（盖章）

日期：

联系人：

电话：

传真：

email: _

二、 通信线路开通流程

上海证通通信线路简介

一、 交易用通信线路简介

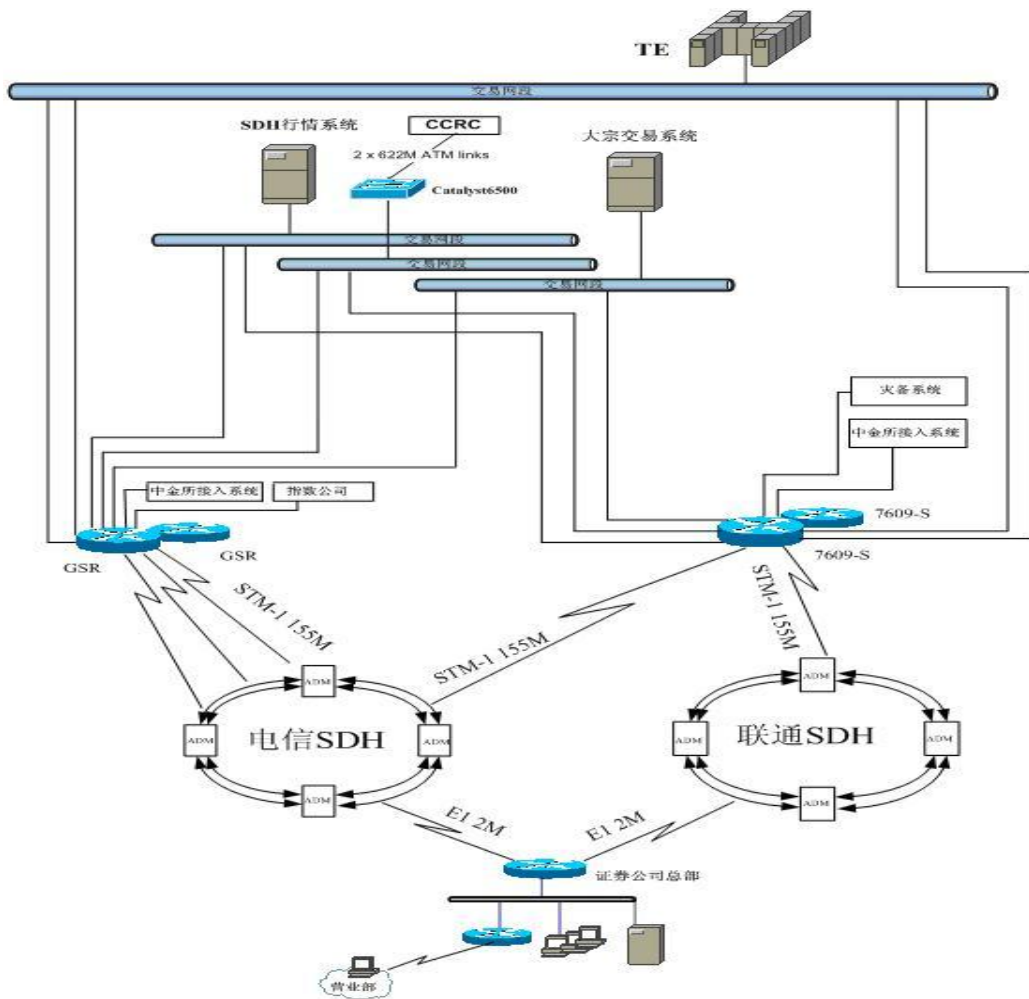
(一) 地面线路 SDH

随着证券市场的快速发展，数据传输对通信网络的要求越来越高。为了满足证券业务发展的需要，保证交易安全，上海证券通信有限责任公司已推出面向上证所会员单位公司总部的 SDH 地面接入通信系统，该系统主要是为配合上证所会员单位实现集中报盘与集中报盘、天地备份而建立的证券通信宽带地面网，以满足不断发展的证券交易业务对通信技术设施的要求。SDH 系统自上海证通以 155M 光纤连接电信 SDH 网络，为上证所会员单位提供 2M 带宽接入，支持上证所目前业务和新增业务的通信需求，也将成为上证所会员单位集中报盘的主要通信手段。

SDH 系统在网络结构上主要采用了星型网络结构，在交易所通信机房建有中心接入系统，各会员分别通过电信的数据通信线路连接到交易所。该星型拓扑结构网络采用高度集中控制，便于网络的管理，所有的信息都必须经过中心节点，以便于统计网络的通信量、报告错误信息、检测和诊断网络故障。

上海证通以 155M 光纤连接电信 SDH 网，各会员则分别以 2M 接入 SDH 网络，与上海证通的通信网络构成了一个具有电信级保护机制的高速网络。

网络拓扑图：



上海证通中心接入系统采用 CISCO 12010 等高速交换路由器，该路由器是提供千兆位交换能力的大型交换路由器。155M 宽带光纤线路的接入旨在满足当今核心骨干网的高带宽、高性能、多业务和多可靠性要求。会员公司 2M 带宽的线路接入，足以满足会员公司总部数据传输业务的需要。

SDH 网络是电信级的高速通信网络，稳定、可靠且易于安装，网络节点分布于全国各地。会员公司如有光端机设备，则可以直接从光端机上输出 2M 线路接入路由器。如没有光端机则可以采用 HDSL 接入，通过转换器接入路由器。

目前，上海证券通信有限责任公司根据交易所整体发展的需求，已将现有的证券交易业务上线传送，其中包括：

1. 上交所现有证券交易品种的交易申报；
2. 发送证券交易行情；
3. 大宗交易；
4. 转发登记公司 Prop 平台上的数据
5. 其他信息。

随着上述业务在 SDH 通信平台上的应用，方便了上证所会员单位业务运作，也提升了整个上证通信网业务应用的稳定性。

(二)、宽带双向卫星线路

通过卫星方式，实现上海证券交易所现有交易品种的交易委托申报。

宽带双向卫星线路可作为 SDH 线路的备份通信线路，实现天地互备，保障交易安全。

注：商业银行可使用 SDH 作为交易用主用通信线路，对交易通信线路有较高安全要求的可选择宽带双向卫星或不同电信运营商的 SDH 线路作为备份。

二、宽带广播系统业务简介：

1. 基本业务

宽带广播系统发送上海证券交易所的各类信息，并为深圳证券交易所转发行情等信息，主要数据包括：上海证券交易所实时行情(show2003.dbf)、即时成交回报、过户清算文件、指定交易文件、上海证券交易所交易运行部发送的各类通知、年报文件、国债利息文件等以及深圳证券交易所实时行情(sj shq.dbf; shszs.dbf; sj sxx.dbf; sj sxxn.dbf; stbhq.dbf; stbxx.dbf)。

2. 增值业务

宽带广播系统同时还为用户发送多媒体信息、中国金融期货交易所实时行情、level-2 行情等增值信息（需另行申请，可向我公司市场部咨询或直接向相应信息供应商申请）。由信息供应商提供多媒体信息或增值信息，并通过上海证券通信有限责任公司的新宽带广播主站系统同时发送给指定的一组新宽带广播用户。

- 多媒体视频业务：主要用于传输上证所投资者教育内容及协助证券公司传输每日股评、内部会议以及员工业务培训等内容。
- 中国金融期货交易所数据业务：为中金所发送股指期货实时行情。
- Level-2 数据业务：为大智慧、钱龙公司发送上交所 level-2 行情。

注：商业银行如需要接收使用上述业务信息可申请开通宽带广播系统小站。

上海证通 SDH 用户小站安装申请指引

- 第一条 为规范上海证券通信有限责任公司（以下简称本公司）SDH 网络建设，保证系统安全、平稳运行，特制定本指引。
- 第二条 向本公司申请安装 SDH 小站的用户，应按要求填写《上海证通 SDH 用户小站安装申请表》（附件一）及《上海证通 SDH 用户小站接入席位清单》（附件二），盖公司章后一式二份寄至本公司市场部，本公司 SDH 小站只接受公司总部级的申请。本公司收到安装申请后进行安装资格审核，审核通过后将返回一份经核准通过的安装申请以示确认。
- 第三条 上海证通 SDH 小站共有两个主站接入端，分别是上证所证券大厦和上海证通地球站，用户申请的第一个 SDH 小站原则上应接入上证所证券大厦（目前上证所证券大厦只提供中国电信线路接入）。
- 第四条 用户应在提交申请并经审核同意后 10 个工作日内支付安装费 1.8 万元，申请使用联通线路的用户还需在 15 个工作日内将《中国联通有限公司专线租用业务协议》复印件传真给本公司，否则本公司有权撤销用户申请。
- 第五条 用户应保证入网申请中的所有信息均真实、完整、准确，如因故必须变更，应及时通知本公司。
- 第六条 用户应在收到经核准通过的安装申请后根据电信运营商要求准备相关小站配套设备及其它所有设备（配置要求见附件三），并自行支付相关设备费用、电信线路开通费及其他相关费用。
- 第七条 用户不得将上海证通 SDH 用户小站转接至其他任何第三方。
- 第八条 在 SDH 小站开通验收完成后，用户须及时将《SDH 宽带接入系统安装用户开通验收单》（附件四）传真给本公司指定协作公司，小站开通日期以本公司的实际开通日期为准。
- 第九条 用户应及时向本公司支付年使用费及小站年入网费。使用费及小站年入网费收费标准详见《上海证通通信接入价格一览表》，本公司有权视情况对收费标准进行调整。（《上海证通通信接入价格一览表》请在本公司网站查询，网址：www.stocom.net）如发生因用户原因未能及时支付费用的情况，本公司有权停止提供所有小站服务。
- 第十条 用户不得擅自更改小站软硬件配置，如需更改，必须经本公司同意，并按

照相关要求¹进行系统测试后方可上线运行。未经本公司许可私自变更小站软硬件配置的用户，须自行承担所有相关责任。

第十一条 用户如需申请中国证券登记结算有限责任公司的 **PROP2000** 业务，可在本公司网站下载《PROP 系统 SDH 联网申请书》，按规定填写并盖公司章后传真至中国证券登记结算有限责任公司。

第十二条 用户如需办理 SDH 小站搬迁或撤销业务，应按本公司公布的相关指引办理手续。如需撤销的小站因用户原因尚未开通，则用户应承担本公司已经发生的实际线路及工程费用。

第十三条 本指引解释权归本公司所有，本公司有权根据实际需要进行修订。

上海证券通信有限责任公司资料：

地址：上海浦东外高桥保税区台中北路 8 号	邮编：200131
开户行：021923-工行新灵路支行	账号：1001192309004613114
市场部（热线电话）：021-58656238	传真：021-58652345
工程部：021-58650101	传真：021-58651638
网管中心（日常运行）：021-58878174	财务：021-58656280

中国证券登记结算有限责任公司联系热线：021-58889260、58888510

中国证券登记结算有限责任公司传真号码：021-58888760

上海证券通信有限责任公司

2010 年 8 月

附件一

上海证通 SDH 用户小站安装申请表

上海证券通信有限责任公司：

本公司因业务需要，兹申请安装一套上海证通 SDH 小站，并同意遵守最新的《上海证通 SDH 用户小站安装申请指引》中所列各项条款。

请填写以下用户基本信息

申请单位全称：

公司详细地址：

建站详细地址：

邮编：

委托联系人：

电话：（请写区号）

传真：

电子邮件：

电信运营商： 中国电信 中国联通

申请接入席位数量：

你单位的上海证通 SDH 用户小站
安装申请已经我公司核准通过。

核准单位：上海证券通信有限责

申请单位：（盖章）

任公司

日期：_____年_____月_____日

日期：_____年_____月

日

附件二

上海证通 SDH 用户小站接入席位清单

上海证券通信有限责任公司：

本公司上海证通 SDH 用户小站共接入以下 _____ 个席位。详细情况如下：

公司名称： _____

席位清单

注：席位之间请用顿号分隔

申请单位：（公司盖章）：

日期： 年 月 日

附件三

上海证通SDH用户小站用户自购设备技术要求

1. Cisco 系列路由器一台；
2. VVIC-1MFT-G703模块一个；
3. 路由器 Ethernet口二个；一个Serial口
4. 双网卡主流PC一台

上海证通宽带双向卫星小站申请安装指引

- 第一条 为规范上海证通宽带双向卫星网络建设，保证系统安全、平稳运行，上海证通通信有限责任公司（以下简称上海证通）特制定本指引。
- 第二条 上海证通宽带双向卫星小站有 3 种传输速率可供选择，分别是 8.3K、64K、128K、256K。
- 第三条 需申请安装上海证通宽带双向卫星小站的用户，应按要求填写两份《上海证通宽带双向卫星小站安装申请表》（附件一），盖公司章后寄至本公司市场部。
- 第四条 本公司审核用户申请后，将盖章并寄回一份《上海证通宽带双向卫星小站安装申请表》。
- 第五条 安装事宜由我公司统筹安排，用户需配合工程实施，在工程完工后及时填写《小站开通验收单》，并根据需要配合签订三方协议。
- 第六条 宽带双向系统小站室内单元、室外单元及高频头设备的所有权归中国联通公司所有，用户不得以任何理由转让、租借和出售，如发生损坏或遗失的情况，须按相关标准进行赔偿（见附件四）。用户需自行准备《上海证通宽带双向卫星小站设备清单》（附件五）中说明需要用户自购的设备。
- 第七条 用户应保证申请表中的所有信息均真实、完整、准确，如因故必须变更，应及时通知本公司。
- 第八条 用户不得擅自更改小站软硬件配置，如需更改，必须经本公司同意，并按照相关要求系统进行测试后方可上线运行。未经本公司许可私自变更小站软硬件配置的用户，须自行承担所有相关责任。
- 第九条 宽带双向卫星小站开通后，用户应按最新发布的《上海证通通信接入价格一览表》及时向本公司和中国联通支付宽带双向卫星小站使用费及小站年入网费。本公司有权视情况对收费标准进行调整。（《上海证通通信接入价格一览表》请在本公司网站查询，网址：www.stocom.net）如发生因用户原因未能及时支付费用的情况，本公司有权停止提供所有小站服务。
- 第十条 用户如需办理搬迁、带宽变更、撤销等业务的，需按上海证通相关指引进行办理。

第十一条 用户如需新建小站、搬迁小站或由用户原因引起的故障维修等上站服务的，需向中国联通指定的协作公司支付相应费用。

第十二条 本公司在非交易期间，为宽带双向卫星用户提供每年不少于两次的全网系统备份测试，为用户网络提供每年不少于四次的系统备份测试，及节假日长假开机测试

第十三条 本指引解释权归上海证通所有，上海证通有权根据实际需要进行修订。

附件一：《上海证通宽带双向卫星小站安装申请表》

附件二：《上海证通宽带双向卫星收费标准》

附件三：《上海证通宽带双向卫星卫星设备价格清单》

附件四：《上海证通宽带双向卫星小站设备清单》

上海证券通信有限责任公司资料：

地址：上海浦东外高桥保税区台中北路8号	邮编：200131
开户行：021923-工行新灵路支行	账号：1001192309004613114
市场部（热线电话）：021-58656238	传真：021-58652345
工程部：021-58650101	传真：021-58651638
网管中心（日常运行）：021-58651399	财务：021-58656280

中国联通资料：

地址：北京市西城区复兴门南大街6号	邮编：100031
户名：中国联合网络通信有限公司北京市分公司	
开户行：工商银行北京分行长安支行	
账号：0200 0033 1921 0012 727	

上海证券通信有限责任公司
2010年8月

附件一

上海证通宽带双向卫星小站安装申请表

上海证券通信有限责任公司：

本公司因业务需要，兹申请安装上海证通宽带双向卫星小站，并同意遵守最新的《上海证通宽带双向卫星小站申请指引》中所列各项条款。

用户申请资料：

公司名称：

公司地址：

联系人：

联系电话：

传真号码：

建站地址：

邮政编码：

传输速率： 8.3K 64K 128K 256K

申请报盘席位数量：

申请报盘席位列表：

申请单位：（公司盖章）
任公司

日期：_____年__月__日

核准单位：上海证券通信有限责

日期：_____年____月_____日

附件二

上海证通宽带双向卫星收费标准

传输速率 (bps)	基本年使用费
8.3K	15000 元
64K	120000 元
128K	240000 元
256K	480000 元

附件三:

上海证通宽带双向卫星设备价格清单

序号	设备名称	规格型号	设备序列号	数量	单位	单价 (人民币元)
1	高频头(LNB)及配件	C波段 DRO		1	套	3000
2	室外单元(ODU)及配件	C波段 (2W)		1	套	8000
3	室内单元(IDU)及配件	LINKSTAR		1	套	13000

附件四

上海证通宽带双向卫星小站设备清单

申请安装上海证通宽带双向卫星小站的用户, 须在上海证通上站安装前自行准备以下设备:

1. 3.0米C波段双向卫星通信天线(一套)
2. 3.0米C波段双向卫星通信天线基础
3. 20米五类网线

注: 以上部分设备可沿用VSAT双向卫星系统的原有设备

中国联通将提供以下业务:

1. 高频头(LNB)及配件(C波段 DRO) 1套
2. 室外单元(ODU)及配件(C波段 (2W)) 1套
3. 室内单元(IDU)及配件(LINKSTAR) 1套
4. 收发电缆(标准配置) 2根

上海证通宽带广播卫星小站安装 申请指引

- 第一条 为规范上海证通宽带广播卫星网络建设，保证系统安全、平稳运行，上海证通通信有限责任公司（以下简称本公司）特制定本指引。
- 第二条 需向本公司申请安装上海证通宽带广播卫星小站的用户，应按要求填写《上海证通宽带广播卫星小站安装申请表》（附件一）及《上海证通宽带广播卫星系统最终用户名单》（附件二），盖公章后一式二份寄至本公司市场部，并保证满足《上海证通宽带广播卫星系统用户小站机房环境、软硬件配置要求》（附件三）。
- 第三条 本公司收到安装申请后进行安装资格审核，并返回一份经核准通过的安装申请以示确认。用户收到本公司返回的安装申请后，应在 10 个工作日内向本公司支付安装费，安装费收费标准为每个小站 5 万元；同时应在 10 个工作日内完成天线基础建设。
- 第四条 用户应保证安装申请中的所有信息均真实、完整、准确，如因故必须变更，应及时通知本公司；如因信息不准确造成设备发运、工程上站服务等有额外支出的，相应费用均由用户承担。
- 第五条 本公司将统筹安排安装事宜，用户应配合本公司进行工程实施，并在工程完工后填写《小站开通验收单》，小站开通日期以本公司的实际开通日期为准。
- 第六条 宽带广播卫星小站室内单元、室外单元及高频头设备的所有权归本公司所有，用户不得以任何理由转让、租借和出售，如因用户原因导致设备损坏或遗失的，须按设备原价进行赔偿（见附件四《上海证通宽带广播卫星小站设备价格清单》）并出具有效遗失证明。用户需自行准备《上海证通宽带广播卫星系统用户小站机房环境、软硬件配置要求》（附件三）中说明需要用户自购的设备。
- 第七条 用户不得擅自将通过宽带广播卫星小站接收到的信息以任何形式转让、租借和传输给安装申请表所列之外的任何单位或个人。
- 第八条 用户不得擅自更改小站软硬件配置，如需更改，必须经本公司同意，并按照相关要求完成系统测试后方可上线运行。未经本公司许可私自变更小站软硬件配置的用户，须自行承担所有相关责任。

第九条 用户应根据付费通知及时向本公司支付年使用费，使用费收费标准详见最新的《上海证通通信接入价格一览表》，本公司有权视情况对收费标准进行调整。（《上海证通通信接入价格一览表》请在本公司网站查询，网址：www.stocom.net）

第十条 用户如需办理搬迁、撤销等业务的，需按本公司相关指引进行办理。

第十一条 本指引解释权归本公司所有，本公司有权根据实际需要进行修订。

附件一：《上海证通宽带广播卫星小站安装申请表》

附件二：《上海证通宽带广播卫星系统最终用户名单》

附件三：《上海证通宽带广播卫星系统用户小站机房环境、系统接收软硬件要求》

附件四：《上海证通宽带广播卫星系统小站设备清单》

上海证券通信有限责任公司资料：

地址：上海浦东外高桥保税区台中北路8号	邮编：200131
开户行：021923-工行新灵路支行	账号：1001192309004613114
市场部（热线电话）：021-58656238	传真：021-58652345
工程部：021-58650101	传真：021-58651638
网管中心（日常运行）：021-58651399	财务：021-58656280

上海证券通信有限责任公司
2009年10月

附件一

上海证通宽带广播卫星小站安装申请表

上海证券通信有限责任公司：

本公司因业务需要，兹申请安装上海证通宽带广播卫星小站，并同意遵守《上海证通宽带广播卫星小站安装申请指引》中所列各项条款。

请填写以下用户基本信息

公司全称：

公司地址：

邮编：

联系人：

电话：（请写区号）

传真：

电子邮件：

本次申请小站安装数量：

你公司的上海证通宽带广播卫星系统入网申请已经我公司核准通过。

核准单位：上海证券通信有限责

申请单位：（公司盖章）
任公司

日期：二〇一__年__月__日
日

日期：二〇一__年__月

附件二

上海证通宽带广播卫星系统最终用户名单

序号	最终用户名称	是否需要发送配套天线	安装地址	邮政编码	联系人	联系电话	登记编号

公司名称:

请单位 (盖章):

注: 登记编号由上海证通生成, 用户无需填写; 行数不够请自行增加。

附件三

上海证通宽带广播卫星系统用户小站机房环境、系统接收软硬件要求

1. 机房环境	符合 GB2887-89 《计算机场地技术条件》和 GB9361-88 《计算机场地安全条件》
2. 供电系统	(1)机房应有单独的配电柜，计算机系统和通信系统要设有独立于一般照明电的专用配电线路，其容量应有一定的余量
	(2)机房应配备不间断电源设备，其容量应保证机房设备在断电情况下维持到后备电源供电
3. 接地与防雷系统	(1)机房应采用独立的工作地和防雷保护地。工作地和防雷保护地之间的距离应大于 20 米
	(2)工作地的接地电阻应小于 2 欧姆，防雷保护地的接地电阻应小于 10 欧姆
4. 系统软件配置	Windows 2000 或 Windows XP，且支持中文显示
5. 系统硬件配置	(1)512M 以上内存
	(2)1G 以上的主流 CPU
	(3)转速 7200 RPM 以上的主流硬盘
	(4)显示器需支持 1024 × 768 的分辨率
	(5)一块声卡和一对音箱（程序报警用）
	(6)两块 100M网卡
6. 天线架设要求	(1)必须提供不小于 4 米 × 4 米的安装空间
	(2)按要求完成 1.8 米天线的基础建设（天线基础要求详见上海证通网站）
	(3)能满足接收亚洲-4 号卫星的需要（方位、仰角）
	(4)能满足天线避雷要求（避雷针）
	(5)保证通信电缆的敷设安全

附件四:

上海证通宽带广播卫星系统小站设备清单

单位: 元

序号	设备名称	设备价格
1	室内单元	15000
2	LNB	3000

三、 报盘系统及技术支持

技术服务文档及软件

上交所网站(www.sse.com.cn)左边栏“业务推介”-“新交易系统专区”有下列文档可以作为参考

1、“技术服务”栏目

上海证券交易所测试环境申请文件 (2010-01-29) —— 市场参与者申请接入测试环境的申请文档和流程说明

2、“技术支持”栏目

- 1) “常见问题”栏目: SSE601_上海证券交易所新一代交易系统市场参与者常见问题解答_20100621 (2010-06-21)
- 2) “数据接口”栏目: SSE301 上海证券交易所新一代交易系统市场参与者 接口规格说明书1.11版_20100517 (2010-05-18)
- 3) “培训材料”栏目: 上海证券交易所新一代交易系统部署启动培训材料 20090210 (2009-02-19)
- 4) “上线全程测试”栏目: SSE102 上海证券交易所新一代交易系统市场参与者 快速指引 部署卷_20090714 (2009-07-14)
- 5) “软件下载栏目”:
 - I 上海证券交易所新交易系统(易神系统)AB股报盘子系统_EzOES_AB_2010版 (2010-09-07) —— 新版,马上就要升级,推荐使用
 - I 上海证券交易所新交易系统(易神系统)AB股报盘子系统 EzOES_ABSHR 2009版update2 (2010-04-08) ——目前使用版本
 - I 上海证券交易所新交易系统(易神系统)盘后文件传输工具 RptGet 2009版 (2009-06-22) ——盘后文件下载工具

3、技术支持方式

技术支持电话: (021)68644780 (交易日8:45-17:00)

技术支持email: tech_support@sse.com.cn

MSN群: group410466@msnzone.cn

文进炜

上海证券交易所技术规划与服务部

电话: 021-68828675

Email: jwwen@sse.com.cn & wenjinwei@gmail.com

集中报盘系统介绍

A/B 股集中报盘系统 (EZOES)

EZOES 为上海证券交易所仿真原有交易系统所开发的向新一代交易系统主机进行委托申报的集中报盘程序，其具有下列特点：

同时支持多操作员

集中报盘程序支持多个操作员同时进行场外报盘，最多支持 20 个操作员（技术上不作限制）。不同的操作员可以连接到不同的数据库，也可以使用同一数据库中不同的数据库表。**不同的操作员既可以通过不同的上行链路报单，也可以共享同一个上行链路报单。**

支持多种数据库版本

目前支持的数据库包括：

MS SQL Server 7.0 及以上版本、

Sybase SQL Server 11.5 及以上版本（必须执行软件配置脚本）、

Oracle 8i 及以上版本、

IBM DB2 9.5 及以上版本。

由于报盘系统基于 Java 平台运行，需要通过 JDBC 连接数据库，相关配置方法参见《软件安装》页的“安装并配置 JDBC 数据源”章节。

网络自动重连

当报盘机与上海证券交易所通信服务器（CS）的主线路中断时，系统会自动尝试重新连接；如果尝试一定次数（由参数 WanRetry 指定）均失败后，系统会自动切换到备份线路，不需要手工停止当前操作员的业务，也不需要重新启动报盘程序。

支持实时监控

报盘机提供文件接口支持实时监控功能，允许用户通过开发监控工具实现对报盘机的实时监控，功能包括查看状态、查看 EZOES 错误信息、启动和停止报盘机、启动和停止交易员等，为集中监视和控制报盘系统提供了便利。上线阶段先行开启监视功能，控制功能待后续版本陆续释放。

EZOES 在软硬件配置方面有如下的要求

硬件配置要求

硬件配置的推荐标准为：

Intel Pentium 4 (3GHz 以上 CPU)；

内存 1G (最低配置 512M)；

两块网卡;
显示器分辨率能够支持 1024*768, 或者更高标准;
如果安装了声卡, 系统在出现故障时就具有发声报警的能力。

软件配置要求

报盘系统运行环境必须满足以下要求:

1. 要求操作系统为下列 32 位系统:

Windows 2000 Professional (SP4+)
Windows 2000 Server (SP4+)
Windows XP Professional (SP1+)
Windows Server 2003, Enterprise Edition

2. 要求 Java 运行环境 (Java Runtime Environment, 即 JRE) 1.6 及其以上版本, 推荐使用版本为 JRE1.6.0_02。
3. 请不要将报盘程机部署在域内, 以免域服务器不定期去修改报盘机的本地时间, 造成报盘机和主机时间的不一致。

注: Java 运行环境的下载和安装请参考《软件安装》页。

数据库软件要求为 SQL Server7.0 及以上版本、Sybase SQL Server11.5 及以上版本、Oracle8i 及以上版本、IBM DB2 9.5 及以上版本。

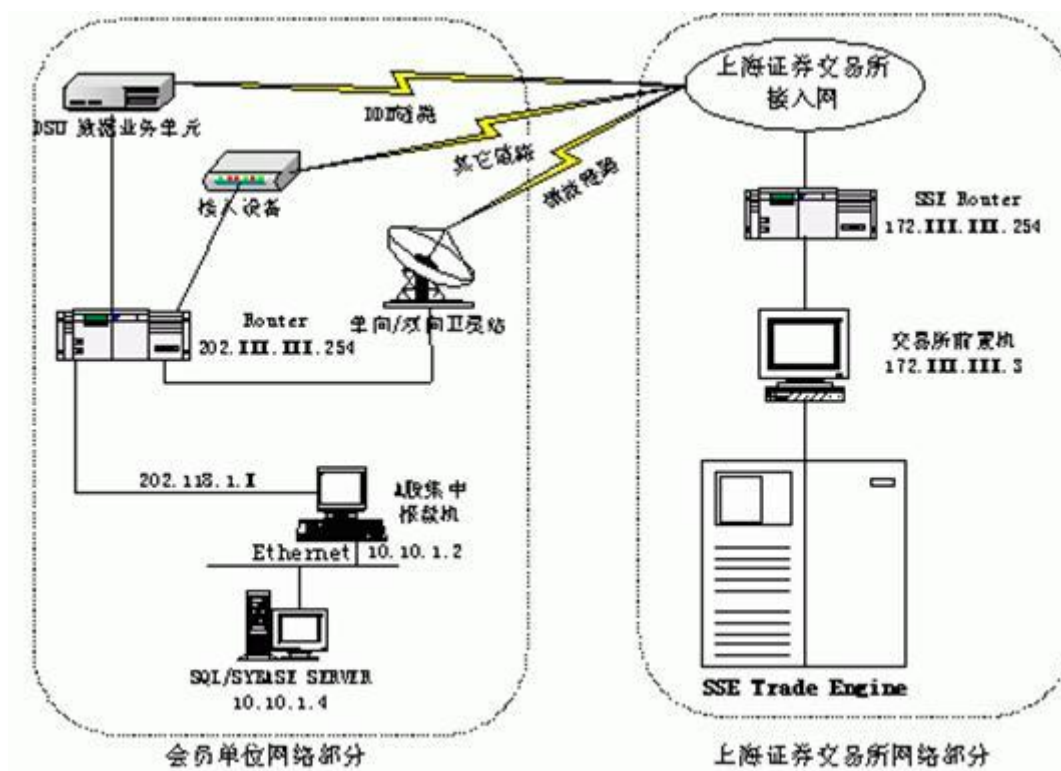
资源信息要求

在安装本软件之前, 请确认下列相关资源信息:

- 会员单位 A/B 股集中报盘机的 IP 地址, 由于报盘机连接两个网段, 通信公司预先分配给营业部 N 个 IP 用来通过专用交易网络连接到交易所通信服务器。因为交易系统允许多个操作员通过相同的 IP 地址登录到通信服务器, 所以上文的 N 可以和操作员数量无关。在本文档中, 假设该类 IP 地址为: 202.118.1.X; 另外 1 个 IP 连接内部网络, 负责读取会员单位所接受的客户交易申报数据, 我们假设该 IP 地址为: 10.10.1.2;
- 会员单位用于存放申报数据的数据库服务器的 IP 地址, 在本文档中, 假设指定 IP 地址为: 10.10.1.4;
- 会员单位路由器(连往 上交所交易通信服务器)的 IP 地址, 在本文档中假设为: 202.118.1.254;
- 上海证券交易所的接入路由器 IP 地址, 在本文档中假设为: 172.XXX.XXX.254;
- 会员单位所连接的上交所通信服务器的 IP 地址, 例如: 172.XXX.XXX.3;

以上信息可以向会员单位的网络管理员垂询。

注：会员单位和上海证券交易所之间网络互连的示意图如下：



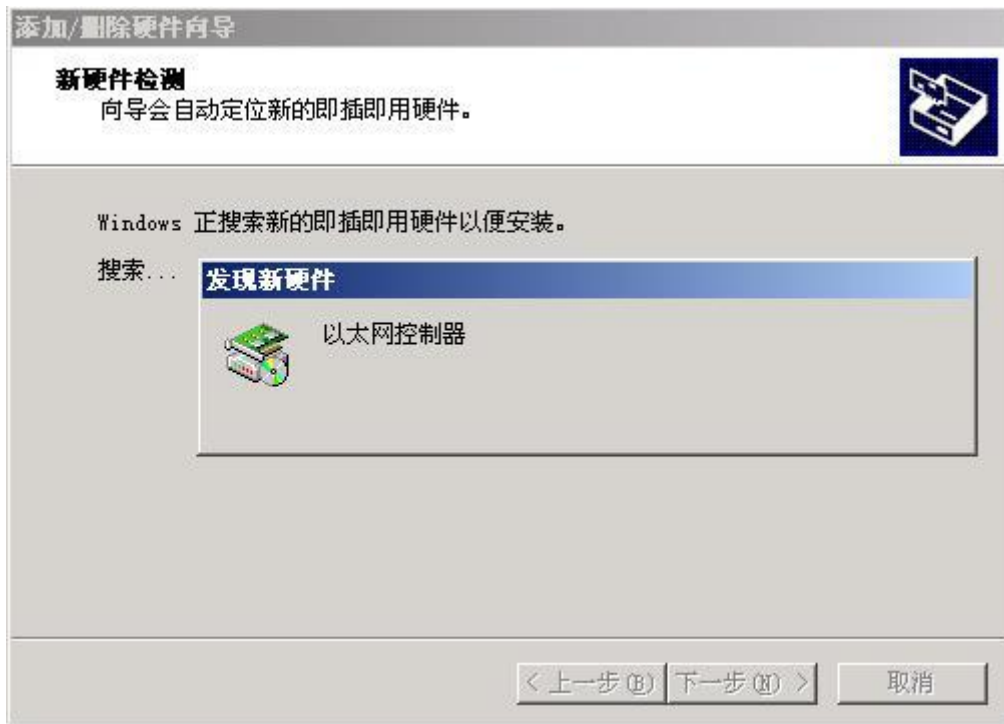
安装网卡并配置参数

下面，我们以 Microsoft Windows2000 Professional（中文版）操作平台为例，介绍报盘机的网络配置过程。

第一步：

在主机母板的 PCI 插槽中插入两块以太网卡，开机后，系统将自动检测新安装的硬件设施，用户可以在这一安装向导的指引下，进行网络适配器及其驱动程序的安装工作。安装过程的截屏图如下所示：

用户也可以通过手工启动“控制面板”中“添加/删除硬件”程序，进行网络适配卡的安装工作。



第二步:

系统检测出网络适配器的类型，并安装相应的驱动程序。系统将检测和安装所有新插入的硬件设施，直至两块网络适配卡都安装完成。



第三步:

分别配置两块网卡的地址参数。

用鼠标右键点击操作系统桌面上的“网络邻居”，在弹出菜单上选择“属性”一

项，系统将弹出“网络与拨号连接”窗口，在该窗口中，我们可以看到新建了两个本地连接，分别对应新安装的两块网络适配卡。在本文档中，“本地连接 1”代表的是与会员单位出口路由器连接的网络接口；“本地连接 2”代表的是与会员单位内部网络相连接的网络接口。

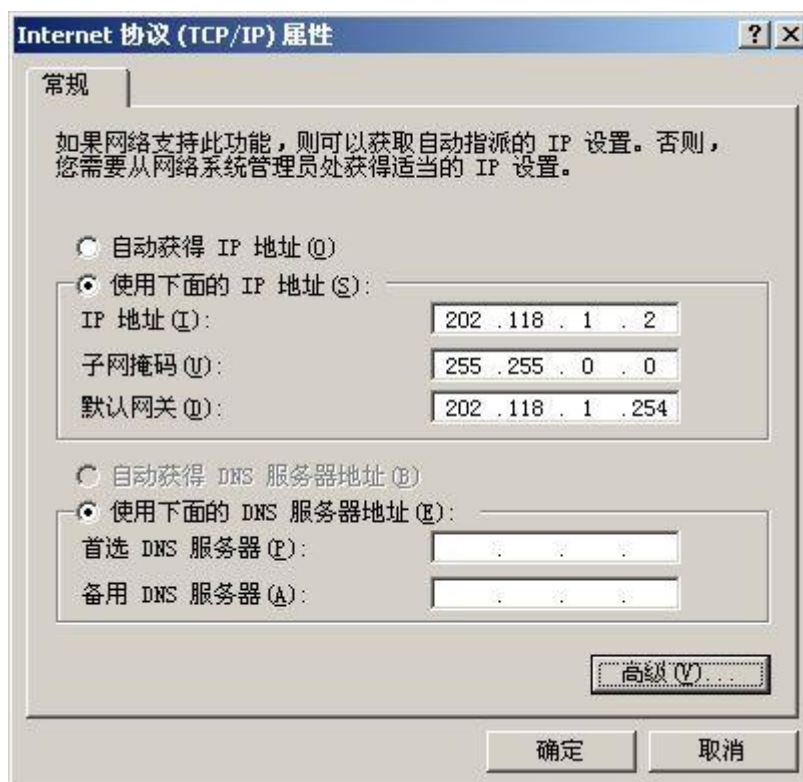


用鼠标右键点击“本地连接 1”图标，选择“属性”一项，系统将弹出有关该连接的属性窗口。



在“属性”窗口中，点击“配置(C)”按钮，可以看到有关该网络适配卡的详细信息。在窗口中部的“组件列表框”中，我们可以已经安装的客户端组件、服务和通信协议，用户可以通过“安装”和“卸载”操作，变更相关的组件。如上图所示，在本例中安装了三个组件。

双击“Internet 协议(TCP/IP)”列表项，系统弹出“Internet 协议(TCP/IP)属性”窗口，在该窗口中配置相关的TCP/IP参数。



选择“使用下面的IP地址”一项，使用固定IP地址。在本文档中，设定第一个操作员使用的外部IP地址为：202.118.1.2、子网掩码为：255.255.0.0、连接到交易所的默认网关IP地址为：202.118.1.254。

新交易系统的报盘机允许重复使用同一个本地IP地址(Local IP)，因而对于多操作员从同一链路报单的情况，并不强制要求在同一块网卡上配置多IP地址。用户若需要在同一个网卡添加多IP，请参考相关技术文档。

用同样的方法配置“本地连接 2”的TCP/IP参数，在本文档中，设定会员单位报盘机的内部IP地址为：10.10.1.2、子网掩码为：255.0.0.0、默认网关的IP地址为：10.10.1.1。

【注意事项】

(1) 会员单位在配置以上两个网络接口属性时，必须根据本单位的网络构造和配置情况填入正确的数值。

(2) 在完成上述TCP/IP属性配置后，用户必须将网线插入正确的网络接口，执行Ping程序，验证网络设置的正确性。为防止用户插错网线，用户可以分两次安装和配置两个网络接口。

检查网络状态

第四步:

最后，我们通过 Ping 应用程序来验证该报盘机网络的网络连通性（关于 Ping 应用程序的使用方法，请参考相关技术文档）。

(1) 检查网卡和协议是否配置正确：

在 DOS 窗口中，分别执行 Ping 10. 10. 1. X 和 Ping 172. XXX. XXX. 3 命令

说明：10. 10. 1. X 和 172. XXX. XXX. 3 分别是本例中报盘主机连接到内部网络和上交所通信服务器的 IP 地址，用户必须用其实际的地址来替代该地址。如果收到目的端返回数据报文，则说明网卡和协议配置正确。

(2) 检查与存放申报数据的数据库服务器的连通性

在 DOS 窗口中，执行 Ping 10. 10. 1. 4 命令

说明：10. 10. 1. 4 是本例中会员单位用于存放申报数据的数据服务器 IP 地址，用户必须用其实际的地址来替代该地址。如果收到目的端返回的数据报文，则说明申报主机与数据服务器之间的网段是连通的。

(3) 检查与会员单位网络路由器的连通性

在 DOS 窗口中，执行 Ping 202. XXX. XXX. 254 命令

说明：202. XXX. XXX. 254 是本例中会员单位网络路由器的 IP 地址，用户必须用其实际的地址来替代该地址。如果收到目的端返回的数据报文，则说明申报主机与会员单位路由器之间的网段是连通的。

(4) 检查与上海证券交易所通信服务器的连通性

执行 route ADD 172. XXX. XXX. 0 MASK 255. 255. 255. 0 202. XXX. XXX. 254 P 命令，在本机路由表中增加一项访问通信服务器的路由信息；

在 DOS 窗口中，执行 Ping w 3000 172. XXX. XXX. 3 命令

说明：

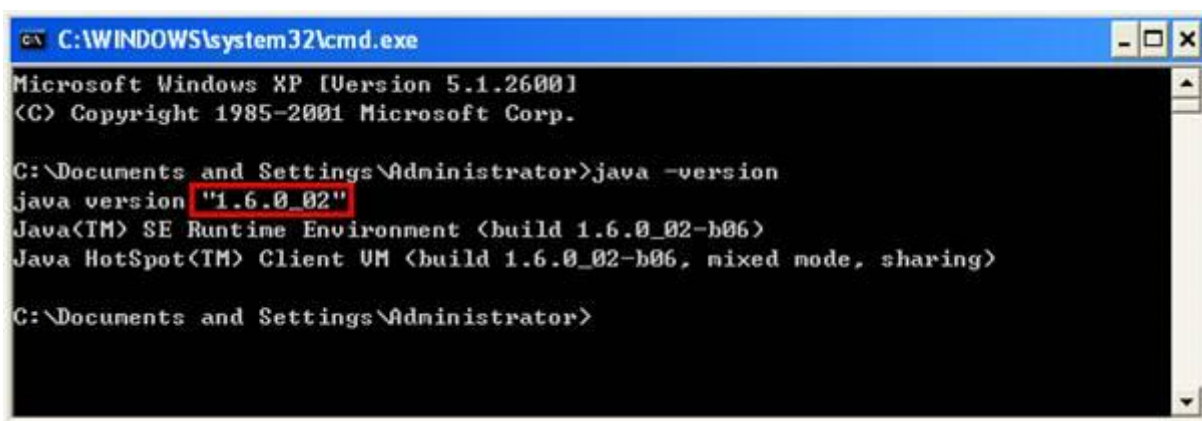
1. 172. XXX. XXX. 3 是本例中交易所通信服务器的 IP 地址，用户必须用其实际的地址来替代该地址。如果报盘机上安装多块网卡，通过不同的线路连接到交易所通信服务器，需要按照实际情况添加多个路由，并需要确认可以通过不同的网卡 Ping 通每一个通信服务器。
2. 如果收到目的端返回的数据报文，则说明会员单位与交易所之间的链路通信正常。
3. 为测试每个上行网卡均能和通信服务器连通，用户可以禁用所有上行网卡，然后依次在仅启用一张网卡的情况下执行 ping 操作。

要运行 EzOES 集中报盘程序，需要下载安装 JRE 和 EzOES 程序本身。

下载并安装 Java 运行环境（JRE）

EzOES 要求版本 1.6 以上的 Java 运行环境，可在命令行输入以下命令以确认运行环境版本：

java -version



```
C:\WINDOWS\system32\cmd.exe
Microsoft Windows XP [Version 5.1.2600]
(C) Copyright 1985-2001 Microsoft Corp.

C:\Documents and Settings\Administrator>java -version
java version "1.6.0_02"
Java(TM) SE Runtime Environment (build 1.6.0_02-b06)
Java HotSpot(TM) Client VM (build 1.6.0_02-b06, mixed mode, sharing)

C:\Documents and Settings\Administrator>
```

EzOES 的安装与设置

下载并安装 EzOES

访问上海证券交易所主页,在“会员\技术服务”栏目下(也可以直接访问网址:<http://www.sse.com.cn/>),用户根据自己的需要选择合适的 EzOES 的安装文件,包括如下版本:

1. 易神系统 AB 股报盘子系统 EzOES_AB;
2. 易神系统 A 股报盘子系统 EzOES_ASHR;
3. 易神系统 B 股报盘子系统 EzOES_BSHR。

下文以“易神系统 AB 股报盘子系统 EzOES_AB”安装为例。

注意: 请确保 EzOES 的安装目标文件夹中不含空格,推荐安装目录为 C 盘根目录(C:\)。

安装完成后在安装目录下自动创建相应目录,其结构如下表所示:

文件/目录名	备注
EzOES_ASHR.exe	应用程序,用于启动 A 股集中报盘系统
EzOES_BSHR.exe	应用程序,用于启动 B 股集中报盘系统
ezoes.ini	应用程序配置文件,该文件的参数同时应用于当前目录下的 A 股集中报盘系统和 B 股集中报盘系统
EzOESMnitorAgent.exe	EzOES 监控程序的探针端,要使用监控工具的话需要先运行该程序
EzOESMnitorAgent.ini	EzOES 监控程序的探针端配置文件
cfgA	子目录,包含 A 股集中报盘系统的配置文件 SystemConfiguration.ini 以及安全授权相关的文件:

cfgB	子目录，包含 B 股集中报盘系统的配置文件： SystemConfiguration.ini 以及安全授权相关的文件：
Cookie	子目录，用于存放用户的 Cookie 文件，文件名为操作员号
drivers	子目录，包含报盘系统的其他数据库类型的 JDBC 驱动程序
help	子目录，包含报盘系统的帮助文件
lib	子目录，包含报盘系统的程序库和默认的 JDBC 驱动程序
license	子目录，用于存放组件授权声明文件
logs	子目录，用于存放报盘程序和监控工具日志文件
misc	子目录，包含报盘系统的图标文件和备用脚本等
monitor	子目录，用于存放实时监控相关的命令文件和状态文件
sql	子目录，包含数据库创建脚本

为方便启动报盘程序，建议创建一个桌面快捷方式，创建方法为：右键单击应用程序文件，例如“EzOES_ASHR.exe”或“EzOES_BSHR.exe”文件，并在弹出菜单中依次选择“发送到(N)”和“桌面快捷方式”。

因 EzOES 程序为绿色软件，卸载极其简单，在关闭该程序和探针程序之后，直接删除 EzOES 文件夹即可。

修改配置文件

安装目录下 cfgA / cfgB 分别为 A、B 股配置文件。配置文件和现有系统基本相同，不同之处如下：

OperCode 请填写 5 位的 PBU 加 6 位的操作员

例如：

OperCode = 2314500001

不同操作员的 LocalIP 允许重复

修改 Gwip 为交易所分配的通信服务器地址，LocalIP 为报盘机本地网卡地址

新添加 jdbc.driver、jdbc.url 两个配置属性

以下参数在新交易系统中已经暂停使用：

1. **GetCJHBFromTE**
2. **GwWay**
3. **DataSource**

4. ConsignTime

5. CjhbTime

安装并配置 JDBC 数据源

在本步骤前，用户必须首先安装数据库服务器并创建数据库（数据库服务器的安装参见数据库相关文档；创建数据库中的表可以使用系统安装后，安装目录的 sql 子目录下的 crebas_XXXXX.sql 文件，其中 XXXXX 标识数据库类型）。

报盘系统基于 Java 平台，通过 JDBC 连接数据库能够提供最佳的效率。JDBC 连接数据库必须具备两个基本条件

1. 正确安装 JDBC 驱动程序；
2. 在配置文件中正确设置 JDBC 驱动程序和对应的数据库 URL，或者启动 EzOES 程序后在操作员的系统参数维护窗口进行设置。

不同数据库类型和版本，采用不同的 JDBC 数据库驱动和 URL 格式，这里逐个进行说明：

MS SQL SERVER 2000 及以上版本用户，JDBC 数据库驱动已经内置在 EzOES 的发布版本中，用户只需填写 jdbc.driver 和 jdbc.url 即可。

```
jdbc.driver=com.microsoft.sqlserver.jdbc.SQLServerDriver
jdbc.url=
```

请用数据库 IP 地址替换 <HOST>，端口替换 <PORT>，数据库名替换 <DBNAME>。

MS SQL SERVER2000 以下版本用户，需要使用 Jtds（一种用于连接 SQL Server 的 JDBC 驱动程序）进行连接。JDBC 数据库驱动需要按照下面的方法下载安装，然后用户只需填写 jdbc.driver 和 jdbc.url 即可。

注：SQL 6.5 用户需要升级到 SQL2000（SP4+）；因此 SQL2000 以下版本用户特指 SQL7 用户。

- a) 访问上海证券交易所主页，在“会员\技术服务”栏目下（也可以直接访问网址：<http://www.sse.com.cn/>），可以找到 JTDS 数据库驱动程序文件 jtds-1.2.2.jar；
- b) 将 jtds-1.2.2.jar 文件复制到 EzOES 的 drivers 目录下，按如下方式修改配置文件：

```
jdbc.driver= net.sourceforge.jtds.jdbc.Driver
jdbc.url=
jdbc:jtds:sqlserver://<HOST>:<PORT>/<DBNAME>;TDS
```

请用数据库 IP 地址替换 <HOST>，端口替换 <PORT>，数据库名替换 <DBNAME>。

Oracle 数据库用户，JDBC 数据库驱动需要按照下面的方法下载安装，然后用户只需填写 jdbc.driver 和 jdbc.url 即可。

- a) 访问上海证券交易所主页,在“会员\技术服务”栏目下(也可以直接访问网址: <http://www.sse.com.cn/>),可以找到 Oracle 数据库驱动程序文件(根据数据库服务器版本下载文件: 8i 版本的驱动文件为 ojdbc14.jar, 9i 及以上版本的驱动文件为 ojdbc6.jar)。
- b) 将相应版本的数据库驱动程序文件复制到 EzOES 的 drivers 目录下,按如下方式修改配置文件:

```
jdbc.driver= oracle.jdbc.driver.OracleDriver
jdbc.url= jdbc:oracle:thin:@<HOST>:<PORT>:<SERVICE>
```

请用数据库 IP 替换<HOST>, 端口替换<PORT>, 数据库服务名替换<SERVICE>。

Sybase 数据库用户, JDBC 数据库驱动需要按照下面的方法下载安装, 然后用户只需填写 jdbc.driver 和 jdbc.url 即可。

- a) 访问上海证券交易所主页,在“会员\技术服务”栏目下(也可以直接访问网址: <http://www.sse.com.cn/>),可以找到 sybase 数据库驱动程序文件 jconn3.jar。
- b) 将 jconn3.jar 文件复制到 EzOES 的 drivers 目录下,按如下方式修改配置文件:

```
jdbc.driver=com.sybase.jdbc3.jdbc.SybDriver
jdbc.url= jdbc:sybase:Tds:<HOST>:<PORT>/<DBNAME>
```

请用数据库 IP 替换<HOST>, 端口替换<PORT>, 数据库名替换<DBNAME>。

注: 要让 Sybase 数据库支持 jConnect, 需要执行相应的存储过程初始化脚本, 这些存储过程脚本可从以下网址下载:

<http://www.sse.com.cn/>

脚本文件名	备注
sql_asa.sql	安装到 SQL Anywhere 和 Adaptive Server Anywhere
sql_server.sql	安装到 Adaptive Server Enterprise versions 11.9.2 和更早版本
sql_server12.sql	安装到 Adaptive Server Enterprise version 12.0
sql_server12.5.sql	安装到 Adaptive Server Enterprise versions 12.5.x
sql_server15.0.sql	安装到 Adaptive Server Enterprise

DB2 数据库用户，JDBC 数据库驱动需要按照下面的方法下载安装，然后用户只需填写 jdbc.driver 和 jdbc.url 即可。

- 访问上海证券交易所主页，在“会员\技术服务”栏目下（也可以直接访问网址：<http://www.sse.com.cn/>），可以找到 DB2 数据库驱动程序文件 db2jcc4.jar。
- 将 db2jcc4.jar 文件复制到 EzOES 的 drivers 目录下，按如下方式修改配置文件：

```
jdbc.driver=com.ibm.db2.jcc.DB2Driver
jdbc.url=jdbc:db2://<HOST>:<PORT>/<DBNAME>
```

请用数据库 IP 替换<HOST>，端口替换<PORT>，数据库名替换<DBNAME>。

注：不可同时安装同一厂商的多个版本数据库驱动程序。

启动报盘机

点击“EzOES_ASHR.exe”可运行 A 股报盘程序。

点击“EzOES_BSHR.exe”可运行 B 股报盘程序。

主操作画面

系统正常启动后出现主操作画面。主操作画面包括以下几个区域：操作员列表区、当前时间显示区、交易主机状态区、交易时间段区和系统信息区。



在生产环境下，主界面如上图所示，其背景色为灰色；对于测试环境，主界面的背

景色将被显示为红色，并且在窗口标题中增加文本说明当前的环境号，内容为“(测试环境[XX])”。

菜单栏

主窗口有三个菜单，分别为“操作”、“报警”和“帮助”，其中“操作”菜单展开后为：



- 1、“全选 (A)”和“取消全选 (Z)”用来控制操作员列表中的“选择”列；
- 2、“批量启动 (S)”和“批量停止 (T)”用来对操作员列表中的被选中操作员进行控制，进行批量启动之前，需要先给相关用户设置密码，参见“修改系统配置画面”；
- 3、“显示系统配置文件 (C)”用来打开当前的配置文件（通过配置工具打开，若工具未与 EzOES 安装在同一位置则给出提示）；
- 4、“配置环境号”用来修改当前所连接的后台环境号码；
- 5、“退出 (Q)”用来关闭报盘程序。

“报警”菜单展开后只有一个子菜单“停止报警”，用来停止报警声音。

“帮助”菜单展开后为：

- 1、“帮助 (C)”打开报盘程序帮助文件；快捷键 F1 也可以打开该帮助文件；
- 2、“关于 (A)”显示当前报盘程序说明。

快捷键说明

点击操作员列表区域，Ctrl+A 快捷键可以选择所有操作员，Ctrl+Z 快捷键可以取消选择所有操作员

操作员列表区

序号	选择	PBU	操作员代码	图	运行状态	CS IP	Local IP	当前工作	发送委托数量	委托应答数量	成交回报数量	流速权值	最大委托序号
1	<input type="checkbox"/>	11111	000001		停止				0	0	0	0	0
2	<input type="checkbox"/>	22222	000001		停止				0	0	0	0	0
3	<input type="checkbox"/>	33333	000001		停止				0	0	0	0	0

该区域显示系统当前所有的操作员及其详细信息，包括：序号、选择、PBU、操作员代码、图、运行状态、CS IP、Local IP、当前工作、发送委托数量、委托应答数量、成交回报数量、流速权值和最大委托序号等。下面仔细阐述每一项的具体含义：

列名	说明
序号	从 1 开始依次累加 1 的 PBU 编号。

选择	用于控制 PBU 的批量启动和批量停止，打钩的 PBU 属于批量操作对象。
PBU	即原先的席位号，由配置文件中 OperCode 项指定，EzOES 启动后画面即显示该项。
操作员代码	由配置文件中 OperCode 项指定，EzOES 启动后画面即显示该项。
图	根据操作员的 不同报单状态 显示不同的图标：绿色表示正常报单，黄色表示正在登录或者由于某种原因暂停报单并且可自动恢复，红色表示异常需要人为干预。
运行状态	操作员任务在系统中所处的状态，包括正在登录、初始化中、运行、正在注销和停止等五种。 其中“运行”字体显示为蓝色，“停止”为红色，其他为黑色字体。
CS IP	即配置文件中的 GWP。是指操作员当前连接的通信服务器 IP 地址，如果操作员在启动状态时发生网络故障，系统会按照配置文件中 GWP 列表的顺序尝试重新连接，这种情况下该项会发生改变。 和交易所主机断开连接后，该项不显示内容。
Local IP	是指操作员当前连接的通信服务器时所对应的本地网卡 IP 地址。在重新连接时该项也会发生改变。 和交易所主机断开连接后，该项不显示内容。
当前工作	操作员任务启动后正在进行的操作，包括：连接数据库、取参考数据、开市、等待开市、已闭市和可停止等。其中连接数据库、取参考数据、取交易时间表均为登录过程中的子工作。 闭市之后，请在“当前工作”切换到“可停止”之后再注销操作员，以避免数据丢失。
发送委托数量	操作员向交易主机发送的委托数量，该项会动态更新。该值显示数据库的委托表中状态为 P 的记录数量，该值与“委托应答数量”同时更新。
委托应答数量	操作员从主机接收的委托应答的数量，该项会动态更新。该值显示数据库的委托确认表中的记录数量，该值与“发送委托数量”同时更新。
成交回报数量	操作员从主机接收的成交回报数量，该项会动态更新。该值显示数据库中成交回报表的记录数量。
流速权值	该值分为流速权和申报性能两个部分，用“/”分割；流速权指操作员在交易所注册过的流速权值，代表该操作员的订单最大发送能力，该项值由交易主机返回；申报性能指上一分钟内写到委托确认表的记录条数；操作员登录成功之后画面即显示该项。
最大委托序号	柜台系统中发送委托表中的最大委托序号，如果委托记录的 RecNum 不是从 1 开始，则该值不再代表委托记录的总条数；

该项会动态更新。

当前时间区

在两种情况下显示不同的内容：

- 在没有任何操作员登录时显示的是本机时间；
- 在有任何一个操作员登录交易所主机之后，系统会从交易主机取交易主机时间并据此显示为“交易系统时间”。

如果有操作员已经连接到交易所主机，则 EzOES 会每两分钟自动和后台同步一次时间。

交易主机状态区

显示当前主机的运行状态，包括：开市前、开市、休市和闭市。交易主机运行状态只有当有操作员登录过才会显示。其中“开市”状态为蓝色，其他状态为红色。

交易时间段区

显示主机的交易时间段。交易时间段也只有当有操作员登录过才会显示。

本地时间（登录前） 交易系统时间（任一操作员登录后）

本地时间： 2008-07-25 13:19:02	交易系统时间： 2007-03-12 09:19:52
交易主机状态：	交易主机状态： 开市
交易时间段：	交易时间段： 00:00:00 -- 23:59:59

系统信息区

提供显示说明和通告，并能够过滤操作员的操作提示以及错误信息。

系统信息 仅显示错误类消息 所有FBU

说明：查看详细错误信息，请在操作员代码上点击鼠标右键，并选择“查看详细”

时间	操作员...	FBU	代码	描述
13:40:25	000001	20130		操作员已退出
13:40:25	000001	20130		交易员登录失败
13:40:25	000001	20130		20130000001数据库连接失败(Login failed for user 'sv'.)
13:40:25	000001	20130		开始连接数据库
13:40:25	000001	20130		开始进行登录
13:40:25	000001	22028		操作员已退出
13:40:25	000001	22028		交易员登录失败
13:40:25	000001	22028		22028000001数据库连接失败(Login failed for user 'sv'.)
13:40:25	000001	22028		开始连接数据库
13:40:25	000001	22028		开始进行登录
13:40:25	000001	20359		操作员已退出
13:40:25	000001	20359		交易员登录失败

- 系统信息区右上角缺省内容为：说明：查看详细错误信息，请在操作员代码上点击鼠标右键，并选择“查看详细”。这是对操作员列表区的提示，系统收到后台的通告消息后将以红色字体在这个区域显示通告内容；
- 过滤功能：缺省情况下“仅显示错误类消息”复选框为空表示在系统信息列表中显示所有内容，点击该复选框后仅显示错误类消息；还可以通过下

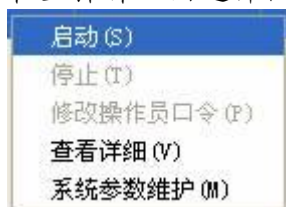
- 拉列表框来选择显示指定 PBU 的信息；
- 3、系统信息列表中的信息显示是按时间采取倒序形式排列，最新的系统信息显示在最上面，并且最近 10 秒内的消息会高亮显示；
 - 4、系统信息对不同类型的信息用不同的颜色进行区分，红色为主机相关错误，蓝色为本地错误，其余提示性信息为黑色；
 - 5、右键点击任何一条消息会提示一个“查看当前 PBU 系统消息 (S)”按钮，点击该按钮可以通过 Windows 记事本程序查看该 PBU 当天的所有系统消息。

状态栏

状态栏分三部分，从左到右分别为版本号、系列号和启用时间。其中系列号栏在前后台时间差超过 10 分钟时会显示前后台的时间差。

操作说明

在主操作画面选择任意操作员后，点击鼠标右键后，系统弹出如下菜单条：



当操作员处于停止或者正在注销状态时，该菜单内的“停止”选项和“修改操作员口令”为不可选；反之当操作员处于启动或者正在登录状态时，“启动”和“修改操作员口令”选项为不可选。

操作员启动画面

A dialog box titled "启动" (Start) with a close button (X). It contains two sections: "操作员" (Operator) and "数据库" (Database). Under "操作员", there are fields for "PBU:" (value: 23145), "操作员代码:" (value: 000001), and "操作员口令:" (empty). Under "数据库", there are fields for "JDBC URL:" (value: 0.10.1.4:1433;databaseName=oiw), "数据库用户:" (value: sa), and "数据库口令:" (empty). At the bottom, there are two buttons: "启动 (S)" and "取消 (C)".

该步骤要求操作员输入连接交易主机的口令和数据库口令，点击“启动”按钮后，该画面即消失，用户可以从主界面的系统信息区看到当前的登录进程。

操作员口令或者数据库口令不正确，系统会给出相应的提示。如果启动成功，系统主画面中对应的操作员信息将会更新，交易主机状态和交易时间段显示交易主机当前的信息。

操作员停止画面

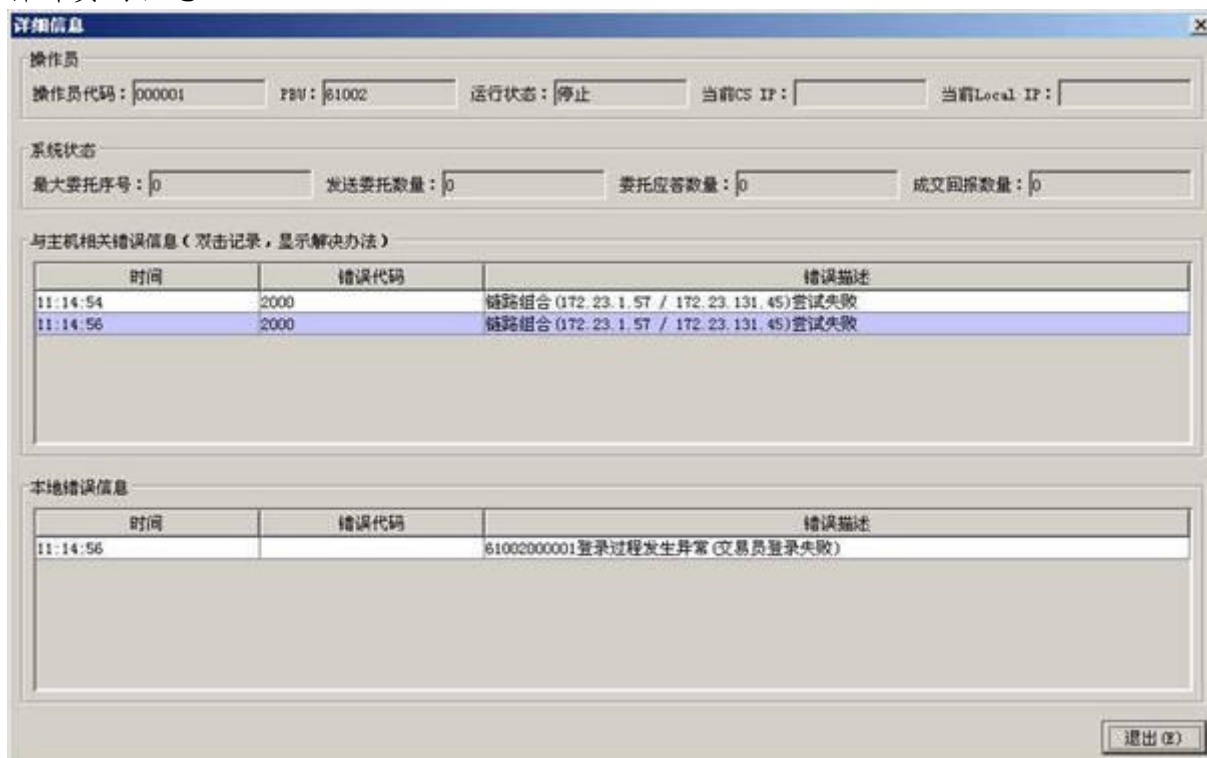
操作员可以在启动后的任意时刻进行停止操作，选中待停止报盘工作的操作员后点击“停止”，出现如下的对话框，点击“是”按钮后该操作员完成当前正在进行的工作以后停止操作员运行，但并不终止整个系统的运行，也不会影响其他正在运行的操作员；点击“否”按钮则取消本操作。



查看详细画面

在系统运行的任意时刻都可以选择某一操作员，点击“查看详细”后查看操作员详细信息。详细信息窗口将系统信息的分为两个列表框来显示：与主机相关的错误信息显示栏和操作员本地信息显示栏。

系统运行的时候，该窗口的 IP 地址、运行状态、最大委托序号、发送委托数量、委托应答数量、成交回报数量等信息可以动态更新，所以也可以根据该窗口来监控操作员的状况。



如果发生错误，相关错误信息也会动态加到与主机相关错误信息栏或者本地错误信息栏。

当系统运行时发生与主机相关的错误，错误现象将列在“与主机相关错误信息”列表中。双击某一错误，系统会弹出相应的解决办法。对于未能提示解决方案的错误，将会提示“未知错误”。

修改系统配置画面

参数修改 (测试环境 [42])

主机配置

操作员代码: PBU:

说明:
修改系统参数后,
启动操作员即可生效!

CS IP列表

编号	CS IP	Local IP
1	198.2.40.1	172.23.131.44
2	198.2.170.1	172.23.131.44

系统出错控制

连接超时秒数: 出错重连次数:

营业系统配置

JDBC Driver: 委托发送表:

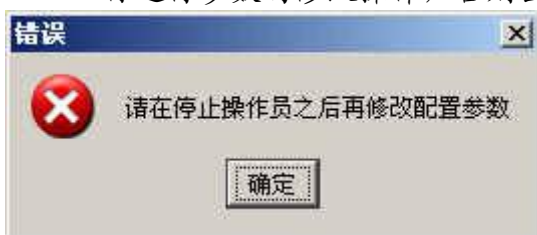
JDBC URL: 委托确认表:

数据库用户名: 成交回报表:

口令配置

操作员口令: 数据库口令:

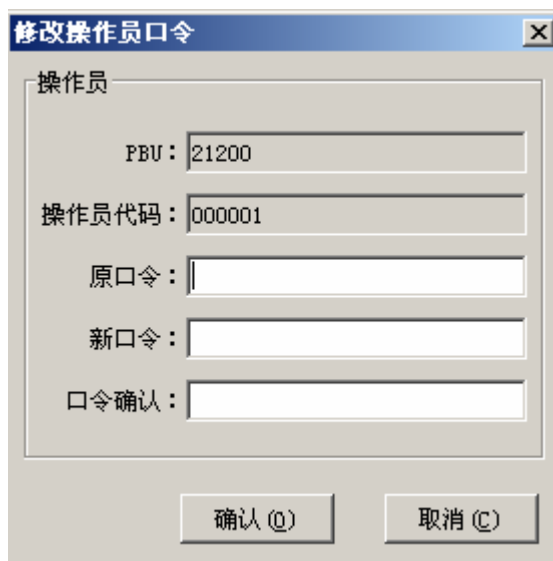
- 1、 在操作员运行期间不能修改该操作员的配置参数。请在停止操作员之后再再进行参数的修改操作，否则会被提示错误。



- 2、 在本窗口修改配置参数并保存后（按“确定”按钮后未提示任何错误）即生效，重新登录操作员时即采用新的配置项。
- 3、 一对链路组合包括一个 CS IP (Gwip) 和一个 Local IP，可以在这个界面调整链路组合对应的 IP，但是不能增加和删除链路组合；增加和删除链路组合需要直接编辑配置文件。
- 4、 口令配置框用来设置批量启动操作员时所用的口令。
- 5、 不再需要设置报盘策略。
- 6、 JDBC 的配置方法参见《下载安装》页的“安装并配置 JDBC 数据源”章节。
- 7、 注意：直接对配置文件进行修改后，需要重新启动报盘程序才生效。建

议直接对配置文件进行编辑时先关闭报盘程序，否则对文件的修改有可能被报盘程序覆盖。

修改操作员口令画面



修改操作员口令

操作员

PBU: 21200

操作员代码: 000001

原口令:

新口令:

口令确认:

确认 (O) 取消 (C)

操作员的口令可以在操作员启动后的任意时刻进行修改，修改后的口令即时生效。

配置环境号画面

报盘程序启动时会检查当前设置的后台环境是否为生产环境，如果不是生产环境，系统会提示用户进行确认：

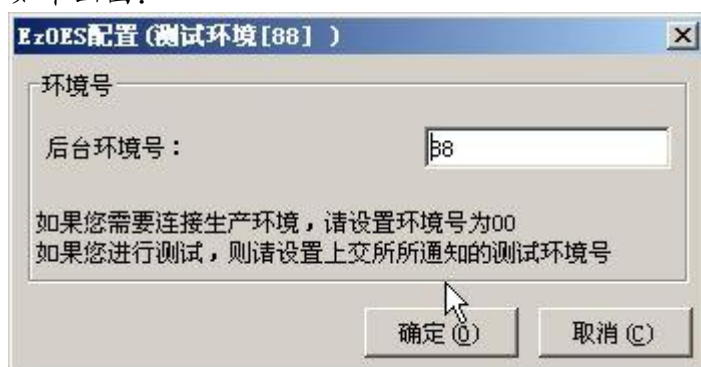


确认

您现在的EzOES配置使用的是#88环境，不是#00生产环境，您需要继续吗？

是 (Y) 否 (N)

此时选择否，或者在主操作画面的“操作”菜单中选择“配置环境号”，系统打开如下画面：



EzOES配置 (测试环境 [88])

环境号

后台环境号: 88

如果您需要连接生产环境，请设置环境号为00
如果您进行测试，则请设置上交所所通知的测试环境号

确定 (O) 取消 (C)

环境号配置成功之后即时生效。不过配置环境号时，必须停止所有操作员，否则系统不进行保存，并给出提示：



校验错误代码

注：错误代码请以接口规格说明书为准，帮助文件中的描述仅供参考。

代码	解释
202	无效操作员代码
203	无效证券代码
204	申报时间为该证券的非交易时间
208	无效买卖标志，非 'B' 或者 'S'
209	交易品种不对
211	此账号不能进行该证券交易
212	价格申报出错
213	证券已被挂起
214	该股票不参与集合竞价
215	无效帐号
216	该帐号未指定在你席位
217	帐号已被挂起
218	无效申报价格
219	申报价不能为零
220	申报价格不符合最小价格步长要求
222	申报价格超出范围
223	申报买入数量必须是 1000 的整数倍
224	无效的申报数量
225	申报数量必须大于 0
226	新股申报数量至少 1000
227	申报数量不符合最小步长要求
228	申报数量超过单笔最大允许申报的上限
231	账号可卖出的余额不足

234	股票持有量超出限量
236	PBU 没有买入权限
237	PBU 没有卖出权限
243	基金帐号\机构帐号不能买卖此证券
244	'S' 帐号不能买入
245	不能撤销指定 (有卖空股票, 请先补回卖空股票)
246	不能撤销指定 (有申报)
247	不能撤销指定 (公司卖空)
248	中国证券登记结算公司不允许撤销指定
250	B 股结算会员代码 (数据库接口中的 firmid) 错, 可从中登公司上海分公司查询
252	无效操作员代码
253	操作员权限不够
257	操作员申报的 rec_num 序号不连续
263	市价订单不参加集合竞价
264	最优五档即时成交剩余撤销市价订单对手方无未成交订单
265	最优五档即时成交剩余转限价市价订单对手方和本方均无未成交订单
266	该券种不允许做市价订单
267	帐户没有权限进行帐户式质押回购的交易及出入库
268	场内报盘对于出入库申报的统一出错代码
269	申报类型错误
270	申报类型错误
271	该帐号已指定在你席位
272	未做指定不能交易
274	信用交易的申报帐户必须是 E 帐户
275	普通交易的申报帐户必须不是 E 帐户
276	该证券不允许担保品买入
277	信用卖出权限不足
278	该证券不允许融资买入
279	卖券还款或融资平仓权限不足
280	买券还券或融券平仓权限不足
281	该证券不允许融券卖出

282	融券卖出申报价格低于最新成交价
283	买券还券、融券卖出、融券平仓申报的信用帐户必须配置证券公司融券专用帐户
401	无效操作员代码
403	无效申报序号
404	撤单对应申报序号检验失败
405	撤单对应的证券帐号检验失败
406	撤单对应的股票代码检验失败
407	撤单对应的买卖方向检验失败
408	对应的申报已经被撤单
409	只能通过买 799998 撤销指定
410	只能通过买 799999 重新指定
411	对应的申报已成交，不能撤单
412	不允许撤单
413	撤单失败, 对应的申报已成交或者已经被撤单
499	无申报可撤
731	基金公司未上传 ETF 申购赎回清单
732	ETF 状态不对
733	ETF 投资者持股不足
734	ETF 现金替代比例超过基金公司规定的比例
735	ETF 基金账号持股余额不足，投资者不能赎回
736	ETF 基金账户不能申购或赎回
752	账户中没有现券
753	账户中现券余额不足
754	账户中没有标准券
755	账户中标准券余额不足
756	账户没有质押券
757	账户的质押券余额不足
758	标准券折算率未初始化
759	标准券代码不存在
1005	登录主机失败
1021	rec_num 必须连续递增

1022	股票代码错误或者非本市场产品
1023	账号错误
1024	买卖方向错误
1025	价格错误
1026	数量错误
1027	日期错误
1028	申报单或撤消单的标志错误
1029	结算会员代码错误
1030	撤消单的 ordrec 域错误
1031	撤消单的 ordrec 域大于等于撤消单的 rec_num 域
1034	撤消的申报单是失败的数据单
1039	刚读入待处理的单子的 status 是' P' 或' p'
1040	刚读入待处理的单子的 status 不是' R'，也不是' P'
1042	底层通讯接收时发生错
1043	接收到的数据包内容错误
1050	撤消的申报单不存在或者撤单申报的证券代码错误
1100	申报号太大
1101	记录不匹配
1102	营业部代码字段 (branchId) 不合法，必须为正整数，且数值必须小于等于 65535
2000	与交易所的网络连接出错
2001	被撤单的日子不是今天
2004	被撤单的帐号不是本人
2006	撤单记录中被撤单的股票代码与被撤单不一致
2007	撤单记录中被撤单的股票价格不正确，与被撤单不一致
2008	只有申报才可被撤单
2101	撤单记录和被撤单记录的股票买卖方向不同
2102	撤单记录和被撤单记录的股票数量不同
10000	内部错误，请联系上交所
10100	无效的产品子类型
10252	该交易时段内禁用该功能
10262	融券卖出不允许申报市价订单

10508	PBU 状态为停止状态
10512	PBU 交易标识为未激活（暂停状态，权限不足）
10516	交易员处于不活动状态
10596	申报价格不符合最小价格步长要求
10708	投资者帐户类型对该产品无效
10796	该帐户类型不允许指定
10804	该帐号已指定在其它席位
10806	该帐户类型不允许撤销指定
10930	不正确的市场状态
10932	产品在当前交易时段不可用
11034	该产品此非交易类型业务今日不开放
11038	无效的分红选择
11040	无效的转托管来源或目的
11042	非交易产品不可用
11068	该 PBU 无权限交易此产品
11080	投资者对该产品没有买权限
11082	投资者对该产品没有卖权限
11128	投资者无此非交易类型业务权限
11130	该产品此非交易类型业务已经被暂停
11150	无效的转换基金
11152	正在进行撤销指定（可能发生在联通 PBU 对该帐户进行撤销指定的同时，本 PBU 进行订单输入的场景；也可能发生在先输入一笔普通交易，然后输入一笔该帐户撤销指定交易的场景）
11166	该帐号已指定在其它席位
11218	不正确的信用标签类型
11236	该 PBU 无融资买入权限
11238	该 PBU 无融券卖出权限
11240	集合竞价最后五分钟不允许删除订单
11266	投资者无此类型产品买权限
11268	投资者无此类型产品卖权限
13304	产品未到上市日
13338	无效的订单类型和产品组合

13360	不能在集合竞价时输入分销类型产品的买单
13398	禁止限价订单交易
13424	超过集合竞价最大订单配置量
13440	该证券不允许买券还券或融券平仓
13448	该证券不允许进行担保品卖出/卖券还款/平仓卖出
13454	不允许撤销非交易订单

网络错误代码

代码	解决办法
1005	登录主机过程中获取交易时段失败。请检查是否在交易时段，如果在交易时段请联系上交所。
1014	具体原因有多种可能，所以具体对策视情况而定。1) 如果是因为网络原因，请用正确的口令和操作员代码尝试重建连接；2) 如果是因为口令错误，请使用正确口令登录；3) 如果是因为该操作员已经在其他地方登录且正在线上，请确认是否使用了正确的操作员登录，或者根据需要向上交所主机房发送传真请求上交所主机房断开该操作员的现有连接；
1015	只有在修改操作员口令时才有可能出现该错误。这时可以退出该操作员的任务，然后重新登录以确认操作员口令是否已经修改。若没有，可以尝试再次修改口令。
2000	底层网路系统错误，网络连接已经不存在，请检查能否 ping 通上交所通信服务器。或者设法重建链路，或者可能的话通过其他可用链路连接到上交所通信服务器。
4001	获取参考数据失败，可以将配置文件中的前置机顺序调换，然后重启报盘机进行连接，如果还是出现该错误，请联系上交所。
4003	请检查旧口令是否正确，或者新口令长度是否正确。

四、 债券发行、交易业务指引

(一) 试点期间业务范围

- 1、上市商业银行可从事与银行间债券市场相同债券品种的一级市场申购和二级市场现券交易
- 2、普通公司债的一级市场申购和二级市场现券交易
- 3、认股权和债券分离交易的可转换公司债券债券部分的二级市场现券交易
- 4、暂不参与证券交易所债券回购业务

(二) 债券发行业务

- 1、国债发行
- 2、公司债（企业债券）网上、网下发行

公司债券（企业债券）分类管理：不能同时达到下列条件的，只能通过固定收益证券综合电子平台进行上市交易：

- （一）发行人的债项评级不低于 AA；
 - （二）债券上市前，发行人最近一期末的净资产不低于 15 亿元人民币；
 - （三）债券上市前，发行人最近三个会计年度实现的年均可分配利润不少于债券一年利息的 1.5 倍；
 - （四）本所规定的其他条件。
- 3、保险公司次级债务、证券公司债券网下发行

(三) 二级市场结构

交易系统	挂牌品种
集中竞价系统	国债、公司债、企业债（分类标准之上）、分离债、可转债、质押式回购
大宗交易系统	同上
固定收益平台	除可转债之外的所有债券现货，包括分类标准之下的公司债（企业债）和定向发行的其他债券

(四) 集中竞价系统交易规则

1. 交易时间

本所交易日为每周一至周五。

国家法定假日和本所公告的休市日，本所市场休市。

采用竞价交易方式的，每个交易日的 9:15 至 9:25 为开盘集合竞价时间，9:30 至 11:30、13:00 至 15:00 为连续竞价时间。

每个交易日 9:20 至 9:25 的开盘集合竞价阶段，本所交易主机不接受撤单申报；其他接受交易申报的时间内，未成交申报可以撤销。撤销指令经本所交易主机确认方为有效。

2. 指定交易

本所市场证券交易实行全面指定交易制度。

证券帐户后必须指定在某一席位后方可进行交易。在指定交易申报的过程中，证券帐户指定交易具体如下：代码为“799999”、数量为“1”，买卖方向为“买入”，价格为“1”。

本所在开市期间接受指定交易申报指令，该指令被交易主机接受后即刻生效。

3. 交易申报

债券现货交易申报应当符合下列要求：

按照债券净价价格进行申报。净价交易指在债券现货交易中，以不含有应计利息的价格申报并成交的交易方式。

交易单位为手，人民币 1000 元面值债券为 1 手；单笔申报最大数量不超过 1 万手。

计价单位为每百元面值债券的价格；

申报价格最小变动单位为 0.01 元。

集合竞价阶段债券交易申报价格最高不高于前收盘价格的 150%，并且不低于前收盘价格的 70%。

连续竞价阶段的有效申报价格应符合下列规定：

申报价格不高于即时揭示的最低卖出价格的 110%且不低于即时揭示的最高买入价格的 90%；同时不高于上述最高申报价与最低申报价平均数的 130%且不低于该平均数的 70%；

即时揭示中无买入申报价格的，即时揭示的最低卖出价格、最新成交价格中较低者视为前项最高买入价格；

即时揭示中无卖出申报价格的，即时揭示的最高买入价格、最新成交价格中较高者视为前项最低卖出价格。

当日无交易的，前收盘价格视为最新成交价格。

4. T+0 交易

债券现货交易中，当日买入的债券当日可以卖出。

5. 撮合原则

在集中竞价交易中，本所依据“价格优先、时间优先”的原则对买卖申报进行撮合成交。

成交时价格优先的原则为：较高价格买入申报优先于较低价格买入申报，较低

价格卖出申报优先于较高价格卖出申报。

成交时时间优先的原则为：买卖方向、价格相同的，先申报者优先于后申报者。先后顺序按交易主机接受申报的时间确定。

集合竞价时，成交价格确定原则为：（一）可实现最大成交量的价格；（二）高于该价格的买入申报与低于该价格的卖出申报全部成交的价格；（三）与该价格相同的买方或卖方至少有一方全部成交的价格。

两个以上申报价格符合上述条件的，使未成交量最小的申报价格为成交价格；仍有两个以上使未成交量最小的申报价格符合上述条件的，其中间价为成交价格。

集合竞价的所有交易以同一价格成交。

连续竞价时，成交价格确定原则为：（一）最高买入申报价格与最低卖出申报价格相同，以该价格为成交价格；（二）买入申报价格高于即时揭示的最低卖出申报价格的，以即时揭示的最低卖出申报价格为成交价格；（三）卖出申报价格低于即时揭示的最高买入申报价格的，以即时揭示的最高买入申报价格为成交价格。

6. 订单方式

集中竞价交易采用限价订单方式进行申报的价格申报买入证券；按限定的价格或高于限定的价格申报卖出证券。限价订单是指按限定的价格买卖债券的订单，即按限定的价格或低于限定的价格申报买入证券；按限定的价格或高于限定的价格申报卖出证券。

7. 开盘价/收盘价

集中竞价的开盘价，为当日该债券集合竞价中产生的价格；集合竞价不能产生开盘价的，连续竞价中的第一笔成交价为开盘价。

集中竞价的收盘价为当日该债券最后一笔成交前一分钟所有成交价的加权平均价（含最后一笔成交）。当日无成交的，以前一交易日的收盘价为当日收盘价。

五、 规则汇编

交易商进入固定收益证券综合电子平台交易，必须遵循上海证券交易所相关业务规则及操作指引。

主要涉及：

1. 上海证券交易所公司债券上市规则（2009年修订版）
2. 关于调整公司债券发行、上市、交易有关事宜的通知
3. 上海证券交易所交易规则
4. 上海证券交易所指定交易实施细则
5. 关于企业债、分离债按证券帐户实行净价交易等事项的通知
6. 关于实施“试行国债净价交易”有关事宜的通知
7. 关于贴现国债实行净价交易有关事宜的通知
8. 公司债券发行和上市业务流程

具体条文如下：

1、上海证券交易所公司债券上市规则 (2009年修订版)

第一章 总则

1.1 为加强对公司债券上市的管理，促进公司债券市场的健康发展，保护投资者的合法权益，根据国家相关法律、法规和《上海证券交易所章程》的规定，制定本规则。

1.2 上市公司及其他公司制法人发行的公司债券在本所上市交易，适用本规则，本所另有规定的除外。

可转换公司债券、可交换公司债券的上市交易，不适用本规则。

非公司制法人所发行的企业债券的上市交易，参照本规则执行。

1.3 发行人申请其所发行的公司债券、企业债券等（以下统称“债券”）在本所上市交易的，应经本所审核同意，并在上市前与本所签订上市协议，明确双方的权利义务和有关事项。

1.4 经证监会核准发行并在本所上市的债券，不得在本所以外的其他场所交易或转让。

1.5 本所根据有关标准，对债券上市、交易实行分类管理。

1.6 本所依据国家证券法律、法规、本规则和本所有关规定对债券发行人及上市推荐人进行监管。

1.7 本所对公司债券上市的核准，不表明对该债券的投资价值或者投资者的收益作出实质性判断或者保证。因公司经营与收益的变化等引致的投资风险，由购买债券的投资者自行负责。

第二章 债券上市条件

2.1 发行人申请债券上市，应当符合下列条件：

- (一) 经有权部门批准并发行；
- (二) 债券的期限为一年以上；
- (三) 债券的实际发行额不少于人民币五千万元；
- (四) 债券须经资信评级机构评级，且债券的信用级别良好；
- (五) 申请债券上市时仍符合法定的公司债券发行条件；
- (六) 本所规定的其他条件。

2.2 对于符合 2.1 条所列上市条件的债券，本所根据其资信等级和其他指标对其上市交易实行分类管理，不能同时达到下列条件的债券，只能通过本所固定收益证券综合电子平台进行上市交易：

- (一) 发行人的债项评级不低于 AA;
- (二) 债券上市前, 发行人最近一期末的净资产不低于 15 亿元人民币;
- (三) 债券上市前, 发行人最近三个会计年度实现的年均可分配利润不少于债券一年利息的 1.5 倍;
- (四) 本所规定的其他条件。

2.3 本所可根据市场情况, 对债券上市条件及分类标准进行调整。

第三章 债券上市申请

3.1 发行人申请债券上市须向本所提交下列文件:

- (一) 债券上市申请书;
- (二) 有权部门批准债券发行的文件;
- (三) 同意债券上市的决议;
- (四) 债券上市推荐书;
- (五) 公司章程;
- (六) 公司营业执照;
- (七) 债券募集办法、发行公告及发行情况报告;
- (八) 债券资信评级报告及跟踪评级安排说明;
- (九) 债券实际募集数额的证明文件;
- (十) 上市公告书(内容与格式见附件 2);
- (十一) 具有证券从业资格的会计师事务所出具的发行人最近 3 个完整会计年度审计报告;
- (十二) 担保人资信情况说明与担保协议(如有);
- (十三) 发行人最近三年是否存在违法违规行为的说明;
- (十四) 债券持有人名册及债券托管情况说明;
- (十五) 本所要求的其他文件。

经中国证监会核准发行公司债券的上市公司可豁免上述第(五)、第(十一)、第(十三)等项内容。

3.2 申请债券上市的发行人应当保证向本所提交的文件内容真实、准确、完整, 不存在虚假、误导性陈述或重大遗漏。

3.3 本所对债券上市实行上市推荐人制度, 债券在本所申请上市, 必须由一至二个本所认可的机构推荐并出具上市推荐书。

3.4 上市推荐人应当符合下列条件:

- (一) 本所会员或本所认可的其他机构;

- (二) 最近一年内无重大违法违规行为;
- (三) 负责推荐工作的主要业务人员应当熟悉本所章程及相关业务规则;
- (四) 本所认为应当具备的其他条件。

3.5 上市推荐人应履行下列义务:

- (一) 确认债券发行人符合上市条件;
- (二) 确保债券发行人的董事、高级管理人员了解其所担责任的性质, 并承担本所上市规则及上市协议所列明的责任;
- (三) 协助债券发行人进行债券上市申请工作;
- (四) 向本所提交上市推荐书;
- (五) 确保上市文件真实、准确、完整, 符合规定要求, 文件所载的资料经过核实;
- (六) 协助债券发行人与本所安排债券上市;
- (七) 本所规定的上市推荐人应当履行的其他义务。

3.6 上市推荐人应当保证发行人的上市申请材料、上市公告书及其他有关宣传材料没有虚假、误导性陈述或者重大遗漏, 并保证对其承担连带责任。

3.7 上市推荐人不得利用其在上市推荐过程中获得的内幕信息进行内幕交易, 为自己或他人牟取利益。

3.8 上市推荐人未能遵守上述规定, 本所按有关法规进行处理。

第四章 债券上市的核准

4.1 本所设立的上市委员会对债券上市申请进行审核, 作出独立的专业判断并形成审核意见, 本所根据上市委员会意见作出是否同意上市的决定。

4.2 债券发行人在提出上市申请至其债券核准上市前, 未经本所同意不得擅自披露有关信息。

4.3 发行人和上市推荐人必须在债券上市交易前完成上市债券在本所指定托管机构的托管工作, 并将债券持有人名册核对无误后报送本所指定托管机构。发行人和上市推荐人对该名册的准确性负全部责任。

4.4 发行人应当在债券上市交易前在证监会指定的信息披露报刊或/及本所网站上公告债券上市公告书, 并将上市公告书、核准文件及有关上市申请文件备置于指定场所供公众查阅。

4.5 债券上市前, 发行人应与本所签订上市协议。

第五章 信息披露及持续性义务

5.1 债券上市后发行人应遵守以下信息披露的基本原则:

(一) 发行人的董事会全体成员必须保证信息披露内容真实、准确、完整，没有虚假、误导性陈述或重大遗漏，并就其保证承担个别和连带的责任；

(二) 发行人应该披露的信息包括定期报告、临时报告。定期报告包括年度报告和中期报告；

(三) 发行人的报告在披露前须向本所进行登记，并向本所提交相同内容的电子格式文件。本所以对定期报告实行事后审查，对临时报告实行事前审查；

(四) 发行人信息在正式披露前，发行人董事会及董事会全体成员及其他知情人，有直接责任确保将该信息的知悉者控制在最小范围内。在公告前不得泄露其内容；

(五) 发行人公开披露的信息涉及财务会计、法律、资产评估、资信评级等事项的，应当由会计师事务所（证券从业资格）、律师事务所、资产评估和评级机构等专业性中介机构审查验证，并出具书面意见；

(六) 本所根据各项法律、法规、规定对发行人披露的信息进行形式审查，对其内容不承担责任。

(七) 发行人公开披露的信息应在至少一种证监会指定的报刊或/及本所网站上予以公告，其他公共传媒披露的信息不得先于指定报刊或/及本所网站。发行人不能以新闻发布或答记者问等形式代替信息披露义务；

(八) 如发行人有充分理由认为披露有关的信息内容会损害企业的利益，且不公布也不会导致债券市场价格重大变动的，经本所同意，可以不予公布；

(九) 发行人认为根据国家有关法律法规不得披露的事项，应当向本所报告，并陈述不宜披露的理由；经本所同意，可免于披露该内容。

5.2 债券上市期间，发行人应当在《证券法》规定的期间内，向本所提交至少记载以下内容的定期报告，并予以公告：

(一) 发行人概况；

(二) 发行人上半年财务会计状况或经审计的年度财务报告；

(三) 已发行债券兑付兑息是否存在违约以及未来是否存在按期偿付风险的情况说明；

(四) 债券跟踪评级情况说明（如有）；

(五) 涉及和可能涉及影响债券按期偿付的重大诉讼事项

(六) 已发行债券变动情况；

(七) 本所要求的其他事项。

5.3 债券上市期间，凡发生下列可能导致债券信用评级发生重大变化，对债券按期偿付产生任何影响等事件或者存在相关的市场传言，发行人应当在第一时间向本所提交临时报告，并予以公告澄清。

(一) 公司发生重大亏损或者重大损失；

(二) 公司发生重大债务和未能清偿到期重大债务的违约情况；

(三) 公司减资、合并、分立、解散、申请破产及其他涉及债券发行人主体变更的决定;

(四) 公司涉及或可能涉及的重大诉讼;

(五) 公司债券担保人主体发生变更或担保人经营、财务状况发生重大变化的情况(如属担保发行);

(六) 国家法律、法规规定和证监会、本所认为必须报告的其他事项。

5.4 发行人应与债券信用评级机构就跟踪评级的有关安排作出约定,并于每年6月30日前将上一年度的跟踪评级报告向市场公告。

债券信用评级机构应及时跟踪发行人的债券资信变化情况,债券资信发生重大变化的,应及时调整债券信用等级,并及时向市场公布。

5.5 债券到期前一周,发行人应按规定在证监会指定的信息披露报刊或/及本所网站上公告债券兑付等有关事宜。

第六章 停牌、复牌、暂停上市、恢复上市、终止上市

6.1 发行人于交易日公布第5.3条所含信息时,本所将视情况对相关债券进行停牌处理。发行人按规定要求披露后进行复牌。

6.2 债券上市交易后,发行人有下列情形之一的,本所对该债券停牌,并在7个交易日内决定是否暂停其上市交易。

(一) 公司出现重大违法行为;

(二) 公司情况发生重大变化不符合债券上市条件;

(三) 发行公司债券所募集的资金不按照核准的用途使用;

(四) 未按照债券募集办法履行义务;

(五) 公司最近二年连续亏损。

上述情形消除后,发行人可向本所提出恢复上市的申请,本所收到申请后15个交易日内决定是否恢复该债券上市。

6.3 债券出现下列情况之一时,终止其上市交易:

(一) 发行人有前条第(一)项、第(四)项所列情形之一,经查实后果严重的,或者有前条第(二)项、第(三)项、第(五)项所列情形之一,在限期内未能消除的,由本所决定终止该债券上市;

(二) 公司解散、依法被责令关闭或者被宣告破产的,由本所终止其债券上市;

(三) 债券到期前一周终止上市交易。

6.4 对本所作出的不予上市、暂停上市、终止上市决定不服的,发行人可向本所设立的复核机构申请复核。

第七章 违反本规则的处理

7.1 发行人及其董事违反本规则有关规定的，本所将视情节轻重，予以下列处理：

- （一）责令改正；
- （二）内部批评；
- （三）在指定报刊上公开谴责；
- （四）报证监会查处。

7.2 上市推荐人违反本规则有关规定的，本所将视情节轻重，予以下列处理：

- （一）责令改正；
- （二）内部批评；
- （三）在指定报刊上公开谴责；
- （四）取消上市推荐人资格；
- （五）报证监会查处。

第八章 附则

8.1 本规则由本所修改和解释。

8.2 本规则自公布之日起施行。

上海证券交易所

2009年11月2日

2. 关于调整公司债券发行、上市、交易有关事宜的通知

各公司债券发行人、各市场参与者：

为保障公司债券发行试点顺利进行，推进公司债券发行、上市、交易的分类管理，促进公司债券市场稳定有序发展，依据中国证监会《公司债券发行试点办法》及本所相关规则，现将公司债券试点期间的发行、上市及交易中的有关事项通知如下。

一、公司债券的发行和上市

（一）试点期间，申请在本所上市的公司债券发行，凡符合本所《公司债券上市规则》第 2.2 条所列标准的，原则上可采用“网上发行和网下发行”相结合的方式，向全市场投资者（包括个人投资者）发行。达不到上述标准的，不得向个人投资者发行，只能向机构投资者发行。

网上发行是将一定比例的公司债券，按确定的发行价格和利率或利率区间，通过本所集中竞价系统面向全市场投资者公开发售。

公司债券网上发行的具体事务，由公司债券的主承销商牵头安排。

试点期间，本所对公司债券网上发行不收取发行手续费。

（二）参与网上发行认购的投资者应使用在中国证券登记结算有限责任公司开立的首位为 A、B、D、F 的证券账户。商业银行参与公司债券发行认购的相关事项由本所另行规定。

（三）网上发行期间，本所集中竞价系统于交易日的 9:30-11:30, 13:00-15:00 接受投资者认购申报，以 1000 元面值为一个认购单位。本所按“时间优先”的原则确认成交后，由中国证券登记结算有限责任公司按其业务规则进行清算、注册登记。

（四）公司债券发行完毕，发行人可按《上海证券交易所公司债券上市规则》相关规定，向本所申请上市，并依之履行相关信息披露义务。

（五）在本所挂牌交易的公司债券须按照本所交易规则和其他相关业务规则进行交易或转让，经本所确认后生效。对违反本规则的行为，本所有权制止；对违规交易，本所有权宣布为无效。

二、公司债券的现货交易

（一）试点期间，符合《上海证券交易所公司债券上市规则》第 2.2 条所列标准的公司债券，可以通过在本所集中竞价系统、大宗交易系统和固定收益证券综合电子平台（以下简称“固定收益平台”）进行交易。达不到上述标准的，只能通过本所固定收益平台进行交易。

（二）公司债券现货交易按账户进行申报，并实行净价交易、全价结算。

（三）固定收益平台的一级交易商可向本所申请，经本所同意后对在固定收益平台挂牌的公司债券进行做市及办理与其客户的协议交易。

三、公司债券的回购交易

(一) 经发行人申请, 并由本所商中国证券登记结算有限责任公司认定, 符合条件的公司债券可作为质押券用于债券质押式回购交易, 由本所在上市通知中予以公布。本所可根据市场情况, 终止特定的公司债券用于债券质押式回购交易。

(二) 公司债券作为质押券进行债券质押式回购交易业务通过本所竞价系统进行; 质押券的申报和转回可通过本所竞价系统和固定收益平台进行, 固定收益平台的交易商可代理客户进行质押券的申报和转回。

(三) 符合以下条件之一的公司债券, 可作为债券质押式回购交易的质押券: (1) 公司债券发行人是中央直属的国有独资企业; (2) 公司债券由中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国交通银行股份有限公司、国家开发银行股份有限公司之一提供全额无条件不可撤销连带责任担保或者提供足额资产抵押担保; (3) 主体评级和债券评级均在 AA 级 (含) 以上; (4) 经中国证监会认可的其他公司债券。

四、市场监管

(一) 公司债券发行人应按照《上海证券交易所公司债券上市规则》相关规定, 履行持续信息披露义务。

(二) 公司债券发行人出现影响或可能影响公司债券还本付息的重大事件, 本所可以视情况暂停其公司债券现货及回购交易, 暂停及恢复交易的时间和方式由本所决定。

(三) 公司债券发行人为本所上市公司的, 若其股票停牌, 本所可以视情况决定暂停公司债券的现货交易及回购交易, 直至相关当事人作出公告的下一交易日予以复牌。

(四) 本所对公司债券交易实行实时监控, 对交易出现异常波动或涉嫌违法违规交易的公司债券可实施特别停牌并予以公告, 停牌及复牌的时间和方式由本所决定。对异常交易及其他违法违规行为, 按照本所相关规定处理。

(五) 会员及其他从事债券交易的机构从事公司债券业务, 应建立完备的业务管理制度及风险控制机制。

会员及其他从事债券交易的机构参与公司债券交易时不得卖空。对违反该规定的, 本所可限制或暂停其在固定收益平台上的债券交易。

五、其他事项

(一) 本通知所指公司债券是《公司债券发行试点办法》(中国证券监督管理委员会第 49 号令) 所称公司债券, 即公司依照法定程序发行、约定在一年以上期限内还本付息的有价证券。

(二) 试点期间公司债券的发行、上市及交易, 适用本通知。本通知未作规定的, 适用本所其他相关规定。

(三) 公司债券的登记、托管和结算及标准券折算比率等事宜按照相关登记机构的规定办理。

本通知所指债券质押式回购交易是指在本所集中竞价系统进行的以标准券为融资额度的质押融资交易。

（四）由国务院有关部门核准的企业债券等，其发行、上市、现货和质押式回购交易比照公司债券相关规定执行。分离交易的可转换公司债券分离出的债券部分，其回购资格条件和质押式回购交易比照公司债券相关规定执行。

（五）公司债券交易产生的行情、指数及附属权利由本所及信息公司所有，使用公司债券行情及开发基于公司债券的衍生产品须得到本所授权。

（六）市场参与者可登陆本所网站（www.sse.com.cn）查阅《上海证券交易所公司债券业务指南》。

（七）本通知发布前已上市但达不到规定分类标准的债券仍可在本所竞价交易系统、大宗交易系统和固定收益平台进行交易。

（八）本通知由本所负责解释，未尽事宜由本所另行规定。原《关于公司债券发行、上市、交易有关事宜的通知》（上证债字[2007]68号）、《关于修订公司债券发行、上市、交易有关事宜的通知》（上证债字[2008]69号）同时废止。

特此通知。

3. 上海证券交易所交易规则

关于发布《上海证券交易所交易规则》的通知

各会员单位：

《上海证券交易所交易规则》已经中国证监会批准，现予以发布。本规则自2006年7月1日起实施，相关业务细则另行公布。

附件：上海证券交易所交易规则

二〇〇六年五月十五日

附件

上海证券交易所交易规则

第一章 总则

1.1 为规范证券市场交易行为，维护证券市场秩序，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券法》等法律、行政法规、部门规章以及《上海证券交易所章程》，制定本规则。

1.2 上海证券交易所（以下简称“本所”）上市的证券及其衍生品种（以下统称“证券”）的交易，适用本规则。本规则未作规定的，适用本所其他有关规定。

1.3 证券交易遵循公开、公平、公正的原则。

1.4 证券交易应当遵守法律、行政法规和部门规章及本所相关业务规则，遵循自愿、有偿、诚实信用原则。

1.5 证券交易采用无纸化的集中交易或经中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）批准的其他方式。

第二章 交易市场

第一节 交易场所

2.1.1 本所为证券交易提供交易场所及设施。交易场所及设施由交易主机、交易大厅、参与者交易业务单元、报盘系统及相关的通信系统等组成。

2.1.2 本所设置交易大厅。本所会员（以下简称“会员”）可以通过其派驻交易大厅的交易员进行申报。

除经本所特许外，进入交易大厅的，仅限下列人员：

- （一）登记在册交易员；
- （二）场内监管人员。

第二节 交易参与人与交易权

2.2.1 会员及本所认可的机构进入本所市场进行证券交易的，须向本所申请取得相应席位和交易权，成为本所交易参与者。

交易参与者应当通过在本所申请开设的参与者交易业务单元进行证券交易。

2.2.2 参与者交易业务单元，是指交易参与者据此可以参与本所证券交易，享有及行使相关交易权利，并接受本所相关交易业务管理的基本单位。

2.2.3 参与者交易业务单元和交易权限等管理细则由本所另行规定，报证监会批准后生效。

第三节 交易品种

2.3.1 下列证券可以在本所市场挂牌交易：

- （一）股票；
- （二）基金；
- （三）债券；
- （四）债券回购；
- （五）权证；
- （六）经证监会批准的其他交易品种。

第四节 交易时间

2.4.1 本所交易日为每周一至周五。

国家法定假日和本所公告的休市日，本所市场休市。

2.4.2 采用竞价交易方式的，每个交易日的 9:15 至 9:25 为开盘集合竞价时间，9:30 至 11:30、13:00 至 15:00 为连续竞价时间，开市期间停牌并复牌的证券除外。

根据市场发展需要，经证监会批准，本所可以调整交易时间。

2.4.3 交易时间内因故停市，交易时间不作顺延。

第三章 证券买卖

第一节 一般规定

3.1.1 会员接受投资者的买卖委托后，应当按照委托的内容向本所申报，并承担相应的交易、交收责任。

会员接受投资者买卖委托达成交易的，投资者应当向会员交付其委托会员卖出的证券或其委托会员买入证券的款项，会员应当向投资者交付卖出证券所得款项或买入的证券。

3.1.2 会员通过其拥有的参与者交易业务单元和相关的报送渠道向本所交易主机发送买卖申报指令，并按本规则达成交易，交易结果及其他交易记录由本所发送至会员。

3.1.3 会员应当按照有关规定妥善保管委托和申报记录。

3.1.4 投资者买入的证券，在交收前不得卖出，但实行回转交易的除外。

证券的回转交易是指投资者买入的证券，经确认成交后，在交收前全部或部分卖出。

3.1.5 债券和权证实行当日回转交易，B股实行次交易日起回转交易。

3.1.6 根据市场需要，本所可以实行一级交易商制度，具体办法由本所另行规定，报证监会批准后生效。

第二节 指定交易

3.2.1 本所市场证券交易实行全面指定交易制度，境外投资者从事B股交易除外。

3.2.2 全面指定交易是指参与本所市场证券买卖的投资者必须事先指定一家会员作为其买卖证券的受托人，通过该会员参与本所市场证券买卖。

3.2.3 投资者应当与指定交易的会员签订指定交易协议，明确双方的权利、义务和责任。指定交易协议一经签订，会员即可根据投资者的申请向本所交易主机申报办理指定交易手续。

3.2.4 本所在开市期间接受指定交易申报指令，该指令被交易主机接受后即刻生效。

3.2.5 投资者变更指定交易的，应当向已指定的会员提出撤销申请，由该会员申报撤销指令。对于符合撤销指定条件的，会员不得限制、阻挠或拖延其办理撤销指定手续。

3.2.6 指定交易撤销后即可重新申办指定交易。

3.2.7 指定交易的其他事项按照本所的有关规定执行。

第三节 委托

3.3.1 投资者买卖证券，应当开立证券账户和资金账户，并与会员签订证券交易委托协议。协议生效后，投资者即成为该会员经纪业务的客户（以下简称“客户”）。

投资者开立证券账户，按本所指定登记结算机构的规定办理。

3.3.2 客户可以通过书面或电话、自助终端、互联网等自助委托方式委托会员买卖证券。电话、自助终端、互联网等自助委托应当按相关规定操作。

3.3.3 客户通过自助委托方式参与证券买卖的，会员应当与其签订自助委托协议。

3.3.4 除本所另有规定外，客户的委托指令应当包括下列内容：

- (一) 证券账户号码；
- (二) 证券代码；
- (三) 买卖方向；
- (四) 委托数量；
- (五) 委托价格；
- (六) 本所及会员要求的其他内容。

3.3.5 客户可以采用限价委托或市价委托的方式委托会员买卖证券。

限价委托是指客户委托会员按其限定的价格买卖证券，会员必须按限定的价格或低于限定的价格申报买入证券；按限定的价格或高于限定的价格申报卖出证券。

市价委托是指客户委托会员按市场价格买卖证券。

3.3.6 客户可以撤销委托的未成交部分。

3.3.7 被撤销和失效的委托，会员应当在确认后及时向客户返还相应的资金或证券。

3.3.8 会员向客户买卖证券提供融资融券服务的，应当按照有关规定办理。

第四节 申报

3.4.1 本所接受会员竞价交易申报的时间为每个交易日 9:15 至 9:25、9:30 至 11:30、13:00 至 15:00。

每个交易日 9:20 至 9:25 的开盘集合竞价阶段，本所交易主机不接受撤单申报；其他接受交易申报的时间内，未成交申报可以撤销。撤销指令经本所交易主机确认方为有效。

本所认为必要时，可以调整接受申报时间。

3.4.2 会员应当按照客户委托的时间先后顺序及时向本所申报。

3.4.3 本所接受会员的限价申报和市价申报。

3.4.4 根据市场需要，本所可以接受下列方式的市价申报：

(一) 最优五档即时成交剩余撤销申报，即该申报在对手方实时最优五个价位内以对手方价格为成交价逐次成交，剩余未成交部分自动撤销。

(二) 最优五档即时成交剩余转限价申报，即该申报在对手方实时五个最优

价位内以对手方价格为成交价逐次成交，剩余未成交部分按本方申报最新成交价转为限价申报；如该申报无成交的，按本方最优报价转为限价申报；如无本方申报的，该申报撤销。

（三）本所规定的其他方式。

3.4.5 市价申报只适用于有价格涨跌幅限制证券连续竞价期间的交易，本所另有规定的除外。

3.4.6 限价申报指令应当包括证券账号、营业部代码、证券代码、买卖方向、数量、价格等内容。

市价申报指令应当包括申报类型、证券账号、营业部代码、证券代码、买卖方向、数量等内容。

申报指令按本所规定的格式传送。本所认为必要时，可以调整申报的内容及方式。

3.4.7 通过竞价交易买入股票、基金、权证的，申报数量应当为 100 股(份)或其整数倍。

卖出股票、基金、权证时，余额不足 100 股(份)的部分，应当一次性申报卖出。

3.4.8 竞价交易中，债券交易的申报数量应当为 1 手或其整数倍，债券质押式回购交易的申报数量应当为 100 手或其整数倍，债券买断式回购交易的申报数量应当为 1000 手或其整数倍。

债券交易和债券买断式回购交易以人民币 1000 元面值债券为 1 手，债券质押式回购交易以人民币 1000 元标准券为 1 手。

3.4.9 股票、基金、权证交易单笔申报最大数量应当不超过 100 万股(份)，债券交易和债券质押式回购交易单笔申报最大数量应当不超过 1 万手，债券买断式回购交易单笔申报最大数量应当不超过 5 万手。

根据市场需要，本所可以调整证券的单笔申报最大数量。

3.4.10 不同证券的交易采用不同的计价单位。股票为“每股价格”，基金为“每份基金价格”，权证为“每份权证价格”，债券为“每百元面值债券的价格”，债券质押式回购为“每百元资金到期年收益”，债券买断式回购为“每百元面值债券的到期购回价格”。

3.4.11 A 股、债券交易和债券买断式回购交易的申报价格最小变动单位为 0.01 元人民币，基金、权证交易为 0.001 元人民币，B 股交易为 0.001 美元，债券质押式回购交易为 0.005 元。

3.4.12 根据市场需要，本所可以调整各类证券单笔买卖申报数量和申报价格的最小变动单位。

3.4.13 本所对股票、基金交易实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为 10%，其中 ST 股票和 *ST 股票价格涨跌幅比例为 5%。

股票、基金涨跌幅价格的计算公式为：涨跌幅价格=前收盘价×(1±涨跌幅比例)。

计算结果按照四舍五入原则取至价格最小变动单位。

属于下列情形之一的，首个交易日无价格涨跌幅限制：

- （一）首次公开发行上市的股票和封闭式基金；
- （二）增发上市的股票；
- （三）暂停上市后恢复上市的股票；
- （四）本所认定的其他情形。

经证监会批准，本所可以调整证券的涨跌幅比例。

3.4.14 买卖有价格涨跌幅限制的证券，在价格涨跌幅限制以内的申报为有效申报，超过价格涨跌幅限制的申报为无效申报。

3.4.15 买卖无价格涨跌幅限制的证券，集合竞价阶段的有效申报价格应符合下列规定：

- （一）股票交易申报价格不高于前收盘价格的 200%，并且不低于前收盘价格的 50%；
- （二）基金、债券交易申报价格最高不高于前收盘价格的 150%，并且不低于前收盘价格的 70%。

集合竞价阶段的债券回购交易申报无价格限制。

3.4.16 买卖无价格涨跌幅限制的证券，连续竞价阶段的有效申报价格应符合下列规定：

- （一）申报价格不高于即时揭示的最低卖出价格的 110%且不低于即时揭示的最高买入价格的 90%；同时不高于上述最高申报价与最低申报价平均数的 130%且不低于该平均数的 70%；
- （二）即时揭示中无买入申报价格的，即时揭示的最低卖出价格、最新成交价格中较低者视为前项最高买入价格；
- （三）即时揭示中无卖出申报价格的，即时揭示的最高买入价格、最新成交价格中较高者视为前项最低卖出价格。

当日无交易的，前收盘价格视为最新成交价格。

根据市场需要，本所可以调整申报价格限制的规定。

3.4.17 申报当日有效。每笔参与竞价交易的申报不能一次全部成交时，未成交的部分继续参加当日竞价，本规则另有规定的除外。

第五节 竞价

3.5.1 证券竞价交易采用集合竞价和连续竞价两种方式。

集合竞价是指在规定时间内接受的买卖申报一次性集中撮合的竞价方式。

连续竞价是指对买卖申报逐笔连续撮合的竞价方式。

3.5.2 集合竞价期间未成交的买卖申报，自动进入连续竞价。

第六节 成交

3.6.1 证券竞价交易按价格优先、时间优先的原则撮合成交。

成交时价格优先的原则为：较高价格买入申报优先于较低价格买入申报，较低价格卖出申报优先于较高价格卖出申报。

成交时时间优先的原则为：买卖方向、价格相同的，先申报者优先于后申报者。先后顺序按交易主机接受申报的时间确定。

3.6.2 集合竞价时，成交价格确定原则为：

- (一) 可实现最大成交量的价格；
- (二) 高于该价格的买入申报与低于该价格的卖出申报全部成交的价格；
- (三) 与该价格相同的买方或卖方至少有一方全部成交的价格。

两个以上申报价格符合上述条件的，使未成交量最小的申报价格为成交价格；仍有两个以上使未成交量最小的申报价格符合上述条件的，其中间价为成交价格。

集合竞价的所有交易以同一价格成交。

3.6.3 连续竞价时，成交价格确定原则为：

- (一) 最高买入申报价格与最低卖出申报价格相同，以该价格为成交价格；
- (二) 买入申报价格高于即时揭示的最低卖出申报价格的，以即时揭示的最低卖出申报价格为成交价格；
- (三) 卖出申报价格低于即时揭示的最高买入申报价格的，以即时揭示的最高买入申报价格为成交价格。

3.6.4 按成交原则达成的价格不在最小价格变动单位范围内的，按照四舍五入原则取至相应的最小价格变动单位。

3.6.5 买卖申报经交易主机撮合成交后，交易即告成立。符合本规则各项规定达成的交易于成立时生效，买卖双方必须承认交易结果，履行清算交收义务。

因不可抗力、意外事件、交易系统被非法侵入等原因造成严重后果的交易，本所可以采取适当措施或认定无效。

对显失公平的交易，经本所认定并经理事会同意，可以采取适当措施，并向证监会报告。

违反本规则，严重破坏证券市场正常运行的交易，本所有权宣布取消，由此造成的损失由违规交易者承担。

3.6.6 依照本规则达成的交易，其成交结果以本所交易主机记录的成交数据为准。

3.6.7 证券交易的清算交收业务，应当按照本所指定的登记结算机构的规定办理。

第七节 大宗交易

3.7.1 在本所进行的证券买卖符合以下条件的，可以采用大宗交易方式：

(一) A 股单笔买卖申报数量应当不低于 50 万股，或者交易金额不低于 300 万元人民币；

(二) B 股单笔买卖申报数量应当不低于 50 万股，或者交易金额不低于 30 万美元；

(三) 基金大宗交易的单笔买卖申报数量应当不低于 300 万份，或者交易金额不低于 300 万元；

(四) 国债及债券回购大宗交易的单笔买卖申报数量应当不低于 1 万手，或者交易金额不低于 1000 万元；

(五) 其他债券单笔买卖申报数量应当不低于 1000 手，或者交易金额不低于 100 万元。

本所可以根据市场情况调整大宗交易的最低限额。

3.7.2 本所接受大宗交易申报的时间为每个交易日 9:30 至 11:30、13:00 至 15:30。

3.7.3 大宗交易的申报包括意向申报和成交申报。

意向申报指令应包括证券账号、证券代码、买卖方向等。

成交申报指令应包括证券代码、证券账号、买卖方向、成交价格、成交数量等。

3.7.4 意向申报应当真实有效。申报方价格不明确的，视为至少愿以规定的最低价格买入或最高价格卖出；数量不明确的，视为至少愿以大宗交易单笔买卖最低申报数量成交。

3.7.5 当意向申报被会员接受（包括其他会员报出比意向申报更优的价格）时，申报方应当至少与一个接受意向申报的会员进行成交申报。

3.7.6 有涨跌幅限制证券的大宗交易成交价格，由买卖双方在当日涨跌幅价格限制范围内确定。

无涨跌幅限制证券的大宗交易成交价格，由买卖双方在前收盘价的上下 30%或当日已成交的最高、最低价之间自行协商确定。

3.7.7 买卖双方达成协议后，向本所交易系统提出成交申报，申报的交易价格和数量必须一致。

成交申报一经本所确认，不得变更或撤销，买卖双方必须承认交易结果。

3.7.8 会员应保证大宗交易参与者实际拥有与意向申报和成交申报相对应的证券或资金。

3.7.9 本所债券大宗交易实行一级交易商制度。

经本所认可的会员，可以担任一级交易商，通过本所大宗交易系统进行债券双边报价业务。

3.7.10 大宗交易不纳入本所即时行情和指数的计算，成交量在大宗交易结束后计入该证券成交总量。

3.7.11 每个交易日大宗交易结束后，属于股票和基金大宗交易的，本所公告

证券名称、成交价、成交量及买卖双方所在会员营业部的名称等信息；属于债券和债券回购大宗交易的，本所公告证券名称、成交价和成交量等信息。

第八节 债券回购交易

3.8.1 债券回购交易包括债券买断式回购交易和债券质押式回购交易等。

3.8.2 债券买断式回购交易是指债券持有人将债券卖给购买方的同时，交易双方约定在未来某一日期，卖方再以约定价格从买方购回相等数量同种债券的交易。

债券质押式回购交易是指债券持有人在将债券质押的同时，将相应债券以标准券折算比率计算出的标准券数量为融资额度而进行的质押融资，交易双方约定在回购期满后返还资金和解除质押的交易。

3.8.3 债券回购交易的期限按日历时间计算。如到期日为非交易日，顺延至下一个交易日结算。

第四章 其他交易事项

第一节 开盘价与收盘价

4.1.1 证券的开盘价为当日该证券的第一笔成交价格。

4.1.2 证券的开盘价通过集合竞价方式产生，不能产生开盘价的，以连续竞价方式产生。

4.1.3 证券的收盘价为当日该证券最后一笔交易前一分钟所有交易的成交量加权平均价（含最后一笔交易）。当日无成交的，以前收盘价为当日收盘价。

第二节 挂牌、摘牌、停牌与复牌

4.2.1 本所以对上市证券实行挂牌交易。

4.2.2 证券上市期届满或依法不再具备上市条件的，本所终止其上市交易，并予以摘牌。

4.2.3 股票、封闭式基金交易出现异常波动的，本所可以决定停牌，直至相关当事人作出公告当日的上午 10:30 予以复牌。

根据市场发展需要，本所可以调整停牌证券的复牌时间。

4.2.4 本所可以对涉嫌违法违规交易的证券实施特别停牌并予以公告，相关当事人应按照本所的要求提交书面报告。

特别停牌及复牌的时间和方式由本所决定。

4.2.5 证券停牌时，本所发布的行情中包括该证券的信息；证券摘牌后，行情中无该证券的信息。

4.2.6 证券开市期间停牌的，停牌前的申报参加当日该证券复牌后的交易；停牌期间，可以继续申报，也可以撤销申报；复牌时对已接受的申报实行集合竞价，

集合竞价期间不揭示虚拟开盘参考价格、虚拟匹配量、虚拟未匹配量。

4.2.7 证券挂牌、摘牌、停牌与复牌的，本所予以公告。

4.2.8 证券挂牌、摘牌、停牌与复牌的其他规定，按照本所上市规则或其他有关规定执行。

第三节 除权与除息

4.3.1 上市证券发生权益分派、公积金转增股本、配股等情况，本所在权益登记日（B 股为最后交易日）次一交易日对该证券作除权除息处理，本所另有规定的除外。

4.3.2 除权(息)参考价格的计算公式为：

除权（息）参考价格 = [（前收盘价格 - 现金红利） + 配（新）股价格 × 流通股
份变动比例] ÷ （1 + 流通股份变动比例）。

证券发行人认为有必要调整上述计算公式的，可向本所提出调整申请并说明理由。本所可以根据申请决定调整除权（息）参考价格计算公式，并予以公布。

除权（息）日即时行情中显示的该证券的前收盘价为除权(息)参考价。

4.3.3 除权（息）日证券买卖，按除权（息）参考价格作为计算涨跌幅度的基准，本所另有规定的除外。

第五章 交易信息

第一节 一般规定

5.1.1 本所每个交易日发布证券交易即时行情、证券指数、证券交易公开信息等交易信息。

5.1.2 本所及时编制反映市场成交情况各类日报表、周报表、月报表和年报表，并予以发布。

5.1.3 本所市场产生的交易信息归本所所有。未经本所许可，任何机构和个人不得使用 and 传播。

经本所许可使用交易信息的机构和个人，未经本所同意，不得将本所交易信息提供给其他机构和个人使用或予以传播。

5.1.4 证券交易信息的管理办法由本所另行规定。

第二节 即时行情

5.2.1 每个交易日 9:15 至 9:25 开盘集合竞价期间，即时行情内容包括：证券代码、证券简称、前收盘价格、虚拟开盘参考价格、虚拟匹配量和虚拟未匹配量。

5.2.2 连续竞价期间，即时行情内容包括：证券代码、证券简称、前收盘价格、最新成交价格、当日最高成交价格、当日最低成交价格、当日累计成交数量、

当日累计成交金额、实时最高五个买入申报价格和数量、实时最低五个卖出申报价格和数量。

5.2.3 首次上市证券上市首日，其即时行情显示的前收盘价格为其发行价，本所另有规定的除外。

5.2.4 即时行情通过通信系统传输至各会员，会员应在本所许可的范围内使用。

5.2.5 根据市场发展需要，本所可以调整即时行情发布的方式和内容。

第三节 证券指数

5.3.1 本所编制综合指数、成份指数、分类指数等证券指数，以反映证券交易总体价格或某类证券价格的变动和走势，随即时行情发布。

5.3.2 证券指数的编制遵循公开透明的原则。

5.3.3 证券指数设置和编制的具体方法由本所另行规定。

第四节 证券交易公开信息

5.4.1 有价格涨跌幅限制的股票、封闭式基金竞价交易出现下列情形之一的，本所公布当日买入、卖出金额最大的五家会员营业部的名称及其买入、卖出金额：

（一）日收盘价格涨跌幅偏离值达到 $\pm 7\%$ 的各前三只股票（基金）；

收盘价格涨跌幅偏离值的计算公式为：收盘价格涨跌幅偏离值=单只股票（基金）涨跌幅-对应分类指数涨跌幅。

（二）日价格振幅达到 15% 的前三只股票（基金）；

价格振幅的计算公式为：价格振幅=（当日最高价格-当日最低价格）/当日最低价格 $\times 100\%$ 。

（三）日换手率达到 20% 的前三只股票（基金）；

换手率的计算公式为：换手率=成交股数（份额）/流通股数（份额） $\times 100\%$ 。

收盘价格涨跌幅偏离值、价格振幅或换手率相同的，依次按成交金额和成交量选取。

对应分类指数包括本所编制的上证 A 股指数、上证 B 股指数和上证基金指数等。

对 3.4.13 规定的无价格涨跌幅限制的股票、封闭式基金，本所公布当日买入、卖出金额最大的五家会员营业部的名称及其买入、卖出金额。

5.4.2 股票、封闭式基金竞价交易出现下列情形之一的，属于异常波动，本所分别公告该股票、封闭式基金交易异常波动期间累计买入、卖出金额最大五家会员营业部的名称及其买入、卖出金额：

（一）连续三个交易日内日收盘价格涨跌幅偏离值累计达到 $\pm 20\%$ 的；

(二) ST 股票和*ST 股票连续三个交易日内日收盘价格涨跌幅偏离值累计达到 $\pm 15\%$ 的;

(三) 连续三个交易日内日均换手率与前五个交易日的日均换手率的比值达到 30 倍, 并且该股票、封闭式基金连续三个交易日内的累计换手率达到 20%的;

(四) 本所或证监会认定属于异常波动的其他情形。

异常波动指标自复牌之日起重新计算。

对 3.4.13 规定的无价格涨跌幅限制的股票、封闭式基金不纳入异常波动指标的计算。

5.4.3 本所根据第 4.2.4 条对证券实施特别停牌的, 根据需要可以公布以下信息:

(一) 成交金额最大的五家会员营业部的名称及其买入、卖出数量和买入、卖出金额;

(二) 股份统计信息;

(三) 本所认为应披露的其他信息。

5.4.4 证券交易公开信息涉及机构的, 公布名称为“机构专用”。

5.4.5 根据市场发展需要, 本所可以调整证券交易公开信息的内容。

第六章 交易行为监督

6.1 本所对下列可能影响证券交易价格或者证券交易量的异常交易行为, 予以重点监控:

(一) 可能对证券交易价格产生重大影响的信息披露前, 大量买入或者卖出相关证券;

(二) 以同一身份证明文件、营业执照或其他有效证明文件开立的证券账户之间, 大量或者频繁进行互为对手方的交易;

(三) 委托、授权给同一机构或者同一个人代为从事交易的证券账户之间, 大量或者频繁进行互为对手方的交易;

(四) 两个或两个以上固定的或涉嫌关联的证券账户之间, 大量或者频繁进行互为对手方的交易;

(五) 大笔申报、连续申报或者密集申报, 以影响证券交易价格;

(六) 频繁申报或频繁撤销申报, 以影响证券交易价格或其他投资者的投资决定;

(七) 巨额申报, 且申报价格明显偏离申报时的证券市场成交价格;

(八) 一段时期内进行大量且连续的交易;

(九) 在同一价位或者相近价位大量或者频繁进行回转交易;

(十) 大量或者频繁进行高买低卖交易;

- (十一) 进行与自身公开发布的投资分析、预测或建议相背离的证券交易;
- (十二) 在大宗交易中进行虚假或其他扰乱市场秩序的申报;
- (十三) 本所认为需要重点监控的其他异常交易。

6.2 会员及其营业部发现投资者的证券交易出现 6.1 条所列异常交易行为之一, 且可能严重影响证券交易秩序的, 应当予以提醒, 并及时向本所报告。

6.3 出现 6.1 条所列异常交易行为之一, 且对证券交易价格或者交易量产生重大影响的, 本所可采取非现场调查和现场调查措施, 要求相关会员及其营业部提供投资者开户资料、授权委托书、资金存取凭证、资金账户情况、相关交易情况等资料; 如异常交易涉及投资者的, 本所可以直接要求其提供有关材料。

6.4 会员及其营业部、投资者应当配合本所进行相关调查, 及时、真实、准确、完整地提供有关文件和资料。

6.5 对情节严重的异常交易行为, 本所可以视情况采取下列措施:

- (一) 口头或书面警示;
- (二) 约见谈话;
- (三) 要求相关投资者提交书面承诺;
- (四) 限制相关证券账户交易;
- (五) 报请证监会冻结相关证券账户或资金账户;
- (六) 上报证监会查处。

如对第(四)项措施有异议的, 可以向本所提出复核申请。复核期间不停止相关措施的执行。

第七章 交易异常情况处理

7.1 发生下列交易异常情况之一, 导致部分或全部交易不能进行的, 本所可以决定技术性停牌或临时停市:

- (一) 不可抗力;
- (二) 意外事件;
- (三) 技术故障;
- (四) 本所认定的其他异常情况。

7.2 出现行情传输中断或无法申报的会员营业部数量超过营业部总数 10%以上的交易异常情况, 本所可以实行临时停市。

7.3 本所认为可能发生第 7.1 条、第 7.2 条规定的交易异常情况, 并会严重影响交易正常进行的, 可以决定技术性停牌或临时停市。

7.4 本所对技术性停牌或临时停市决定予以公告。

7.5 技术性停牌或临时停市原因消除后, 本所可以决定恢复交易。

7.6 除本所认定的特殊情况外, 技术性停牌或临时停市后当日恢复交易的,

技术性停牌或临时停市前交易主机已经接受的申报有效。交易主机在技术性停牌或临时停市期间继续接受申报，在恢复交易时对已接受的申报实行集合竞价交易。

7.7 因交易异常情况及本所采取的相应措施造成的损失，本所不承担责任。

第八章 交易纠纷

8.1 会员之间、会员与客户之间发生交易纠纷，相关会员应当记录有关情况，以备本所查阅。交易纠纷影响正常交易的，会员应当及时向本所报告。

8.2 会员之间、会员与客户之间发生交易纠纷，本所可以按有关规定，提供必要的交易数据。

8.3 客户对交易有疑义的，会员应当协调处理。

第九章 交易费用

9.1 投资者买卖证券成交的，应当按规定向代其进行证券买卖的会员交纳佣金。

9.2 会员应当按规定向本所交纳会员费、交易经手费及其他费用。

9.3 证券交易的收费项目、收费标准和管理办法按照有关规定执行。

第十章 纪律处分

10.1 会员违反本规则的，本所责令其改正，并视情节轻重单处或并处：

- (一) 在会员范围内通报批评；
- (二) 在证监会指定的媒体上公开谴责；
- (三) 暂停或者限制交易；
- (四) 取消交易资格；
- (五) 取消会员资格。

10.2 会员对前条(二)、(三)、(四)、(五)项处分有异议的，可以自接到处分通知之日起15日内向本所理事会申请复核。复核期间不停止相关处分的执行。

第十一章 附则

11.1 交易型开放式指数基金、债券、债券回购、权证等品种的其他交易事项，由本所另行规定。

11.2 本规则中所述时间，以本所交易主机的时间为准。

11.3 本所有关股票、基金交易异常波动的规定与本规则不一致的，按本规则执行。

11.4 本规则下列用语含义：

(一) 市场：指本所设立的证券交易市场。

(二) 上市交易：指证券在本所挂牌交易。

(三) 委托：指投资者向会员进行具体授权买卖证券的行为。

(四) 申报：指会员向本所交易主机发送证券买卖指令的行为。

(五) 标准券：指由不同债券品按相应折算率折算形成的，用以确定可利用质押式回购交易进行融资的额度。

(六) 最优价：指集中申报簿中买方的最高价或卖方的最低价。集中申报簿指交易主机中某一时点按买卖方向以及价格优先、时间优先顺序排列的所有未成交申报队列。

(七) 虚拟开盘参考价格：指特定时点的所有有效申报按照集合竞价规则虚拟成交并予以即时揭示的价格。

(八) 虚拟匹配量：指特定时点按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的申报数量。

(九) 虚拟未匹配量：指特定时点不能按照虚拟开盘参考价格虚拟成交并予以即时揭示的买方或卖方剩余申报数量。

11.5 本规则经本所理事会通过，报证监会批准后生效。修改时亦同。

11.6 本规则由本所负责解释。

11.7 本规则自 2006 年 7 月 1 日起施行。

4. 上海证券交易所债券交易实施细则（2008修订稿）

关于发布实施《上海证券交易所债券交易实施细则》（2008年修订）的通知

各会员单位、市场参与者：

为促进债券市场发展，本所对《上海证券交易所债券交易实施细则》（以下简称“《细则》”）进行了修订。现就主要修订内容和相关事项通知如下。

一、原《细则》第二条修改为：国债、公司债券、企业债券、分离交易的可转换公司债券中的公司债券（以下统称“债券”）在竞价交易系统的现货交易及质押式回购交易，适用本细则，本细则未作规定的，适用交易规则及本所其他有关规定。

债券在本所固定收益证券综合电子平台的交易，由本所另行规定。

本所上市的可转换公司债券和其他债券品种，适用交易规则及本所其他有关规定。

二、原《细则》第四条增加第二款为：会员应当对其向本所发出的债券交易申报指令的合法性、真实性、准确性及完整性负责并承担相应的法律责任。会员将客户债券申报作为回购质押券或者申报进行债券现券交易的，视为会员已经获得其客户的同意，本所对此不负审查义务。（新《细则》第三条）

三、原《细则》第八条修改为：债券现货实行净价交易，并按证券账户进行申报。（新《细则》第六条）

四、本所已上市的企业债券在计入持有者证券账户后按证券账户进行申报。

五、企业债券和分离交易的可转换公司债券中的公司债券进行净价交易的实施时间，由本所另行通知。

特此通知。

附件：上海证券交易所债券交易实施细则（2008年修订）

二〇〇八年九月二十六日

附件

上海证券交易所债券交易实施细则

（2008年修订）

第一章 总则

第一条 为规范上海证券交易所（以下简称“本所”）债券市场交易行为，维护市场秩序，防范市场风险，保护投资者的合法权益，根据国家有关法律法规和《上海证券交易所交易规则》（以下简称“交易规则”），制定本细则。

第二条 国债、公司债券、企业债券、分离交易的可转换公司债券中的公司债券（以下统称“债券”）在竞价交易系统的现货交易及质押式回购交易适用本细则，本细则未作规定的，适用交易规则及本所其他有关规定。

债券在本所固定收益证券综合电子平台的交易，由本所另行规定。

本所上市的可转换公司债券和其他债券品种，适用交易规则及本所其他有关规定。

第三条 投资者通过本所竞价交易系统进行债券交易，应按照本所全面指定交易的规定，事先指定一家会员作为其债券交易受托人，并与其订立全面指定交易协议、债券现货交易及债券回购交易委托协议。

会员应当对其向本所发出的债券交易申报指令的合法性、真实性、准确性及完整性负责并承担相应的法律责任。会员将客户债券申报作为回购质押券或者申报进行债券现券交易的，视为会员已经获得其客户的同意，本所对此不负审查义务。

第四条 会员及其他从事债券交易的机构，应建立完备的业务管理制度及风险控制机制。

会员不得擅自使用客户的证券账户或者挪用客户债券为自己或他人从事债券回购交易。违反本规定者，本所可限制或暂停其从事债券回购交易业务，直至取消交易资格，情节严重的，提交中国证监会查处。

第五条 债券交易的登记、托管和结算，由本所指定的证券登记结算机构按照相关规则办理。

第二章 债券现货交易

第六条 债券现货实行净价交易，并按证券账户进行申报。

第七条 债券现货交易中，当日买入的债券当日可以卖出。

第八条 债券现货交易集中竞价时，其申报应当符合下列要求：

- （一）交易单位为手，人民币 1000 元面值债券为 1 手；
- （二）计价单位为每百元面值债券的价格；
- （三）申报价格最小变动单位为 0.01 元；
- （四）申报数量为 1 手或其整数倍，单笔申报最大数量不超过 1 万手；
- （五）申报价格限制按照交易规则的规定执行。

第九条 债券现货交易开盘价，为当日该债券集合竞价中产生的价格；集合竞价不能产生开盘价的，连续竞价中的第一笔成交价为开盘价。

债券现货交易收盘价为当日该债券最后一笔成交前一分钟所有成交价的加权平均价（含最后一笔成交）。当日无成交的，以前一交易日的收盘价为当日收盘价。

第三章 债券回购交易

第十条 债券回购交易实行质押库制度，融资方应在回购申报前，通过本所交易系统申报提交相应的债券作质押。用于质押的债券，按照证券登记结算机构的相关规定，转移至专用的质押账户。

第十一条 会员接受投资者的债券回购交易委托时，应要求投资者提交质押券，并对其证券账户内可用于债券回购的标准券余额进行检查。

标准券余额不足的，债券回购的申报无效。

第十二条 债券回购交易申报中，融资方按“买入”予以申报，融券方按“卖出”予以申报。

第十三条 当日购买的债券，当日可用于质押券申报，并可进行相应的债券回购交易业务。

第十四条 质押券对应的标准券数量有剩余的，可以通过本所交易系统，将相应的质押券申报转回原证券账户。当日申报转回的债券，当日可以卖出。

第十五条 债券回购交易集中竞价时，其申报应当符合下列要求：

- （一）申报单位为手，1000元标准券为1手；
- （二）计价单位为每百元资金到期年收益；
- （三）申报价格最小变动单位为0.005元或其整数倍；
- （四）申报数量为100手或其整数倍，单笔申报最大数量不超过1万手；
- （五）申报价格限制按照交易规则的规定执行。

第十六条 债券回购交易设1天、2天、3天、4天、7天、14天、28天、91天和182天等回购期限。

根据市场需要，本所可调整债券回购期限和品种。

第十七条 债券回购交易实行“一次成交、两次结算”制度，具体的清算交收，按照证券登记结算机构的规则办理。

第十八条 回购到期日，证券登记结算机构根据购回价公式计算应进行交割的资金和质押券数量。

购回价计算公式为：购回价=100元+年收益率×100元×回购天数/360。

第十九条 债券回购交易期限按日历时间计算。若到期日为非交易日，顺延至下一个交易日。

第二十条 债券回购交易的融资方，应在回购期内保持质押券对应标准券足额。

债券回购到期日，融资方可以通过本所交易系统，将相应的质押券申报转回原

证券账户，也可以申报继续用于债券回购交易。当日申报转回的债券，当日可以卖出。

第二十一条 可作质押式回购的债券品种，由本所在债券上市通知中予以公布。本所可根据市场或发行人情况变化，暂停有关债券用于质押式回购交易。

第四章 附则

第二十二条 本细则下列术语含义为：

（一）净价交易：指在债券现货交易中，以不含有应计利息的价格报价并成交的交易方式。

（二）质押式回购交易：指将债券质押的同时，将相应债券以标准券折算比率计算出的标准券数量为融资额度而进行的质押融资，交易双方约定在回购期满后返还资金和解除质押的交易。其中，质押债券取得资金的交易方为“融资方”；作为其对手的交易方为“融券方”。

（三）标准券：由不同债券品种按相应折算比率折算形成的，用以确定可通过质押式回购交易进行融资的额度。

（四）标准券折算比率：指各债券现券品种所能折成的标准券金额与债券面值之比。

（五）质押券：指申报提交给证券登记结算机构，作为债券回购交易质押物的债券。

第二十三条 本细则经本所理事会讨论通过后生效，修改时亦同。

第二十四条 本细则由本所负责解释。

第二十五条 本细则自发布之日起实施。

5、上海证券交易所指定交易实施细则

(2007年5月)

第一条 为规范上海证券交易所(以下简称“本所”)指定交易行为,保护投资者权益,维护证券交易秩序,根据《上海证券交易所交易规则》及其他规定,制定本细则。

第二条 本所市场交易参与人以及交易参与人的客户(投资者)均应遵守本细则。

第三条 本细则所称指定交易是指,凡在本所市场进行证券交易的投资者,必须事先指定本所市场某一交易参与人,作为其证券交易的唯一受托人,并由该交易参与人通过其特定的参与者交易业务单元(以下简称“交易单元”)参与本所市场证券交易的制度。

第四条 投资者在办理指定交易时,须通过其委托的交易参与人向本所交易系统申报证券帐户的指定交易指令。申报经本所交易系统确认后即时生效。

第五条 已办理指定交易的投资者,根据需要可以变更指定交易。

第六条 办理指定交易变更手续时,投资者须向其原指定交易的交易参与人提出撤销指定交易的申请,并由原交易参与人完成向本所交易系统撤销指定交易的指令申报。申报一经确认,其撤销即刻生效。

投资者具有下列情形之一的,交易参与人不得为其申报撤销指定交易:

- (一) 撤销当日有交易行为的;
- (二) 撤销当日有申报;
- (三) 新股申购未到期的;
- (四) 因回购或其他事项未了结的;
- (五) 相关机构未允许撤销的。

第七条 撤销指定交易的投资者,在撤销指定交易的手续办妥后,必须按本细则规定另行选择一个交易参与人重新办理指定交易申请后,方可进行交易。

第八条 对拥有两个或以上交易单元的交易参与人,可以办理所属交易单元的联通手续。

第九条 本所将根据交易单元实施情况,及时对本细则予以修订补充。

第十条 本细则由本所负责解释。

第十一条 本细则自二〇〇七年五月十五日起实施。一九九七年七月二十八日发布的《上海证券交易所全面指定交易制度试行办法》同时废止。

上海证券交易所

二〇〇七年五月十四日

6. 关于企业债、分离债按证券帐户实行净价交易等事项的通知

各会员单位：

为了促进债券市场的发展，本所将于 2008 年 10 月 13 日，对企业债及分离交易的可转换公司债券中的公司债（以下称“分离债”）的交易申报模式和报价方式进行调整，申报模式将改现行的按交易单元申报为按证券帐户申报，报价方式将改按全价申报为净价申报，全价结算。符合条件的企业债和分离债将可用于质押式回购。现将相关事项和要求通知如下，请会员单位做好相关工作。

一、相关业务调整的主要内容

（一）将现行企业债（证券代码段为 120 和 129）交易，由以会员名义按交易单元申报交易改为按证券帐户申报，相关前端控制由会员负责。

（二）企业债和分离债（证券代码段为 126）同时在本所竞价交易系统和固定收益证券综合电子平台挂牌，均实行净价交易，全价结算。

（三）可用于质押式回购的企业债和分离债具体名单由本所另行通知，相关出入库证券代码见本所 2008 年 9 月 23 日发布的《关于启用 105 代码段的通知》。

（四）企业债和分离债的质押申报和转回，可通过本所竞价交易系统和固定收益证券综合电子平台进行。

通过竞价交易系统买入的债券，当日可进行质押券入库申报；通过竞价交易系统质押券出库申报成功的债券，当日可卖出。

（五）证券公司客户企业债专用帐户（以下简称“专用帐户”）不能买入企业债，也不能参与质押式回购，其中已有的企业债只能卖出。相关前端控制由会员负责。

（六）企业债和分离债的兑付兑息安排及收费标准，比照公司债券办理。

二、业务实施准备和要求

会员单位应按照《关于做好企业债按证券帐户净价交易的相关技术准备的通知》和《关于做好企业债按债券帐户净价交易的相关数据报送工作的通知》，认真做好各项技术准备和数据报送工作。

（一）10 月 10 日 21 点到 11 日 8 点为正式申报阶段。各会员单位应特别注意如下几点：

1、10 月 6 日至 10 日的试申报期间的试申报数据，将在 10 月 10 日闭市后被清空。

2、各会员单位必须在正式申报阶段申报正式数据，最后一次有效报送数据将被作为企业债入帐户处理依据，相关企业债据此记入指定帐户。

3、规定时段截止后，如各会员单位未报送或报送无效的，原记录在客户债券结算单元的企业债，将被全部记入专用帐户。对于原记录在证券公司自营、基金公司、保险公司或财务公司等机构自营债券结算单元的企业债，无论参与人有效申报总量是否与其自有或租用债券结算单元相同代码企业债持有总量一致，都记入其事先申报的证券帐户。

（二）10 月 11 日 12 点，中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（以下

简称“中国结算”)将向市场发布入帐户后的企业债余额数据,请各会员单位及时接收。

(三)本所和中国结算将于10月11日16点至17点进行全市场测试,具体安排另行通知。

特此通知。

二〇〇八年十月六日

7. 关于实施“试行国债净价交易”有关事宜的通知

各会员单位：

根据财政部、中国人民银行和中国证券监督管理委员会《关于试行国债净价交易有关事宜的通知》（财库[2001]12号）精神，现将有关事宜通知如下：

一、实施“试行国债净价交易”时间

从2002年3月25日（星期一）起实施。

二、净价交易概念

净价交易是指在现券买卖时，以不含有自然增长应计利息的价格报价并成交的交易方式。在净价交易条件下，由于国债交易价格不含有应计利息，其价格形成及变动能够更加准确地体现国债的内在价值、供求关系及市场利率的变动趋势。

三、实行国债净价交易后，应计利息额的计算方法

应计利息额=票面利率÷365（天）×已计息天数

上述公式各要素具有以下含义：

1、应计利息额：零息国债是指发行“起息日”至“成交日”所含利息金额；附息国债是指本付息期“起息日”至“成交日”所含利息金额。

2、票面利率：固定利率国债是指发行票面利率；浮动利率国债是指本付息期计息利率。

3、年度天数及已计息天数：1年按365天计算，闰年2月29日不计算利息；已计息天数是指“起息日”至“成交日”实际日历天数。

4、当票面利率不能被365天整除时，计算机系统按每百元利息额的精度（小数点后保留8位即数据类型位为N15.8）计算；交割单所列“应计利息额”按“4舍5入”原则，以元为单位保留2位小数列示。

5、国债交易计息原则是“算头不算尾”，即“起息日”当天计算利息，“到期日”当天不计算利息；交易日挂牌显示的“每百元应计利息额”是包括“交易日”当日在内的应计利息额；若国债持有到期，则应计利息额是自“起息日”至“到期日”（不包括到期日当日）的应计利息额。

四、国债净价交易遵循的原则

实行国债净价交易仍将遵守本所现行的交易规则，其次：

1、实行净价申报和净价撮合成交，以成交价格 and 应计利息额之和作为结算价格。

2、国债净价交易以每百元国债价格进行报价，应计利息额按每百元国债所含利息额列示。

3、报价系统和行情发布系统同时显示净价价格和应计利息额。

4、在场内申报终端和各证券营业部的行情系统显示的“应计利息额”均为参

考值，各会员单位应以中国证券登记结算有限责任公司上海分公司公布的“当日国债品种应计利息额”数据文件的数据为准进行资金清算。

5、交易清算及交割单打印系统，应自动计算应计利息额并在交割单上分别列明“结算价”、“净价”及“应计利息额”。

国债净价交易是新的交易方式，对证券市场和相关领域会产生较大影响，因此，各有关单位应遵循积极稳妥的原则，按要求做好各项准备工作，确保试行国债净价交易的顺利实施。

附件：上海证券交易所国债净价交易技术方案

二〇〇二年三月十八日

附件

上海证券交易所国债净价交易技术方案

根据中国证监会和国家财政部的要求，本所将试行国债的净价交易制度。为了配合该制度的平稳实施，本所研究制定了相关的技术方案。

一、本所试行国债净价交易遵循的原则

1、实行净价申报和净价撮合成交，以成交价格 and 应计利息额之和作为结算价格。

2、报价系统和行情发布系统应同时显示净价价格和应计利息额，本所的国债交易以每百元国债价格进行报价，应计利息额也按每百元国债所含利息额列示。

二、技术准备

1、券商参与国债交易以净价申报，即场内交易大厅和场外报盘中国债的申报价应输入净价。本所同样以净价撮合成交，成交价亦为净价。在场内交易大厅的申报终端和大屏上增加显示每百元国债所含利息额。交易所发布的国债即时成交回报中的价格和金额为净价价格和以净价价格计算的成交金额。

2、为方便参与国债交易的市场各方揭示国债利息信息和计算国债结算价，中国证券登记结算有限责任公司上海分公司将通过 PROP2000 平台把当日每百元国债应计利息额文件发送给券商（具体参照中国证券登记结算有限责任公司上海分公司另行发布的通知）。同时，本所也将通过卫星广播系统和本所网站及时将当日每百元国债应计利息额文件发送给券商，该文件的格式附后说明。

3、收市后本所发给券商的成交库中的国债成交价为国债净价，国债成交金额为以国债净价计算的成交金额。清算库中国债的成交金额亦为以净价计算的成交金额。成交库和清算库的格式保持不变。

4、券商可以根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司发送的清算文件进行清算（具体参照中国证券登记结算有限责任公司上海分公司另行发布的通知），也可根据本所的成交文件、清算文件和当日国债应计利息额文件，计算出结算价（结算价 = 净价 + 应计利息额）。

附：

当日国债品种应计利息额数据文件说明：

I 文件名：GZLX.MDD

其中：M表示月份，M=1, 2, 3... .., 9, A, B, C;

DD表示日，DD = 01, 02,, 31

I 文件格式：DBF 格式

I 文件内容：所有国债当日应计利息额

I 发送时间：每天

I 数据结构：

序号	字段名	类型	字段描述	备注
1	GZDM	C6	国债品种代码	
2	JXRQ	C8	计息日期	YYYYMMDD
3	YJLX	N15.8	每百元应计利息额	单位：元
4	LXTS	N6	利息天数	
5	PML	N8.5	票面利率	

8、公司债券发行和上市业务流程

一、相关法律、法规及规则

《中华人民共和国公司法》(2005年10月27日)

《中华人民共和国证券法》(2005年10月27日)

《公司债券发行试点办法》(2007年8月15日)

《上海证券交易所公司债券上市规则》(2007年9月18日)

《上海证券交易所关于公司债券发行、上市、交易有关事宜的通知》(2007年9月19日)

《关于国务院有关主管部门核准发行、登记到证券账户债券发行、登记、托管、交易、结算和收费等相关事宜的通知》(2008年6月10日)

二、发行方式

以确定的发行利率或利率区间通过交易系统以场内挂牌的方式向社会公众公开销售(场内挂牌网上发行),及/或网下面向特定投资者协议发行。

三、发行流程

FT日为发行首日,以下日期均为工作日,下同。

FT-15日前

☆ 若发行人拟在募集说明书及发行公告中明确公司债券上市后可进行新质押式回购,发行人应提前向本所提交申请(附件一)。本所受理发行人申请后,将及时征询中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)意见,并将最终结果通知发行人。

FT-7日前

☆ 发行人向本所债券基金部提交E-KEY使用申请。

FT-5日前

☆ 公司债券拟通过上海证券交易所交易系统发行的,发行人和主承销商应向本所债券基金部提交《通过上海证券交易所交易系统发行公司债券的申请》(附件二),初步确定发行与上市代码、发行与上市简称、发行期、发行数量、发行价格、主承销商帐号及席位等。

注：发行代码按 751990—751999 十个代码依次循环使用

FT-4 日前

- ☆ 发行人向本所债券基金部提交募集说明书全文及概要、发行公告进行预审。

FT-3 日前

- ☆ 取得证监会债券发行批文后，发行人和主承销商向本所债券基金部书面提交证监会批文、募集说明书全文及摘要、发行公告最终稿等，正式确定上述发行要素。同时，发行人应及时联系本所公司管理部，刊登证监会核准发行公告。
- ☆ 发行人在下午三点前将相关公告通过 E-KEY 上传至本所业务系统。
- ☆ 本所债券基金部对募集说明书和发行公告进行审核。主承销商自行联系指定报刊，并最晚于 FT-2 日刊登募集说明书概要和发行公告。
- ☆ 本所债券基金部安排募集说明书及发行公告在本所网站的同步上网相关事宜。
- ☆ 发行人和中国结算上海分公司签署《证券登记及服务协议》等有关协议。

FT-2 日

- ☆ 募集说明书概要和发行公告最晚见报日和上网日。

FT-1 日前

- ☆ 主承销商确定发行利率或利率区间，并于 FT 日前（含当日）刊登利率确定公告（可与发行公告合并），并以书面形式报告本所债券基金部。

FT-1 日

- ☆ 主承销商通过现有的债券分销注册数据文件（文件模版由债券基金部提供）将发行电子注册数据发本所债券基金部（经技术中心）转中国结算上海分公司。

注：公司债分销注册数据中主承销商账户应登记本次全部发行数量（包括网上和网下）。

FT 日前

- ☆ 拟参与公司债券网上、网下发行的机构和个人在中国结算上海分公司开立合格证券账户。

FT 日至网上发行截止日

- ☆ 主承销商于交易时间将网上发行数量以既定的发行价格卖出。
- ☆ 网上发行期间，本所通过现有的 A 股实时成交数据接口将公司债网上发行成交数据发送给中国结算上海分公司。
- ☆ 中国结算上海分公司每日末进行清算。有效认购可于下一工作日日终或认购次二个工作日查询到注册结果。注册数据的证券代码为本期公司债网上发行的证券代码。
- ☆ 网上发行截止日下一工作日日终或次二工作日，主承销商确认网上发行是否有余额。若有则启动回拨机制。

FT 日至网下发行截止日

- ☆ 拟参与公司债券网下发行的特定投资者在网下发行期间联系公司债券主承销商，主承销商根据网下特定投资者认购意向进行簿记建档，与投资者协商确定认购数量，签订“认购协议”，办理划款等事宜。

FT+n 日 网下发行截止日 (2<n<=5)

网下发行原则上不超过五个工作日。网下发行截止日应晚于网上发行截止日至少两个工作日。

- ☆ 主承销商按要求将网下发行的注册数据于截止日次日 11 点前以书面（盖章）形式报本所债券基金部，并按要求生成电子数据文件在当日 11 点前发本所债券基金部（经技术中心）转中国结算上海分公司。
- ☆ 中国结算上海分公司统一于网下发行截止日次日对网下协议认购数据进行注册。若注册数据无误，网下协议认购的投资者可通过指定交易的券商于主承销商申报日的下一工作日查询到注册结果。注册数据的证券代码为本期公司债网上发行的证券代码，而非本期公司债券的上市后的证券代码。

FT+5 日至上市日

- ☆ 发行人向中国结算上海分公司提交证券登记申请，中国结算上海分公司向发行人出具证券登记证明及持有人名册。
- ☆ 网下发行截止日至上市日前一工作日 12 点前，若发生网下发行资金划付违约或注册数据错误，可由主承销商取得已注册方书面同意后以书面形式向本所申请错误调帐。本所审核后，向中国结算上海分公司发送债券调整业务通知单，中国结算上海分公司依据通知办理注册数据错误调整。
- ☆ 主承销商按约定将债券款缴付发行人。发行人出具验资报告交本所债券基金部。

四、上市审核流程

T 日为公司债券上市日。

T-4 日前

☆ 发行人及主承销商提交上市申请材料:

- 1、债券上市申请书（格式见附件三）；
- 2、证监会批准发行的文件；
- 3、发行人同意债券上市的决议；
- 4、债券上市推荐书；
- 5、公司章程；
- 6、公司营业执照；
- 7、债券募集办法、发行公告及发行情况报告；
- 8、债券资信评级报告及跟踪评级安排说明；
- 9、债券实际募集数额的证明文件；
- 10、上市公告书；
- 11、具有证券从业资格的会计师事务所出具的发行人最近 3 个完整会计年度审计报告；
- 12、担保人资信情况说明与担保协议(如属担保发行)；
- 13、发行人最近三年是否存在违法违规行为的说明；
- 14、债券持有人名册及债券托管情况说明（主要是托管证明）；
- 15、本所要求的其他文件。

经中国证监会核准发行公司债券的上市公司可豁免上述第 5、第 11、第 13 等项内容。

T-3 日

☆ 本所债券基金部对申请材料（主要是上市公告书）进行形式审查。

T-2 日

☆ 本所债券基金部将“关于核准 ×× 公司债券上市交易的通知”交发行人，同时办理上市公告书 T-1 日上网程序；发行人联系指定报刊同时刊登上市公告书。

☆ 发行人及主承销商将下列材料提交公司管理部:

- 1、债券上市申请书;
- 2、债券上市推荐书;
- 3、债券资信评级报告及跟踪评级安排说明;
- 4、上市公告书;
- 5、担保人资信情况说明与担保协议(如属担保发行);
- 6、本所要求的其他文件。

☆ 本所债券基金部制作“证券上市协议书”一式两份,交发行人盖章。

☆ 本所债券基金部制作“公司债券上市费用缴款通知”(附件四),传真或邮递给发行人或主承销商。

☆ 做好上市仪式准备工作(若有)。

T-1 日

☆ 发行人刊登上市公告书(报纸);债券基金部将其同时发布到本所网站。

☆ 债券基金部落实上市仪式有关事宜(若有)。

T 日 公司债正式上市交易。

☆ 债券基金部进行仪式现场协调(若有),完成公司债挂牌。

☆ 将签署的“证券上市协议书”一式两份,分送发行人和本所留底。

8. 关于贴现国债实行净价交易有关事宜的通知

各会员单位：

根据财政部、中国人民银行和中国证券监督管理委员会《关于贴现国债实行净价交易的通知》（财库〔2007〕21号）精神，本所将自2007年8月10日起对贴现发行的零息国债实行净价交易，现将有关事项通知如下：

一、实施“贴现国债净价交易”时间：从2007年8月10日起实施。

二、应计利息额计算方法

贴现发行的零息国债应计利息额采用实际天数法计算：

$$\text{应计利息额} = \frac{\text{到期兑付额} - \text{发行价格}}{\text{起息日至到期日的天数}} \times \text{起息日至结算日的天数}$$

其中，应计利息额、到期兑付额和发行价格均按壹百元人民币为单位表示。

三、本通知未尽事宜，依照《关于实施“试行国债净价交易”有关事宜的通知》（上证推字〔2002〕1号）执行。

特此通知。

二〇〇七年七月三十一日

六、 收费标准

品种	收费项目	费率	备注
现券	经手费	按成交金额的 0.00001 双向收取	暂免
	证管费	按成交金额的 0.00001 双向收取	019、020 代码段国债交易的证管费暂免征收

七、 业务联系方式

1. 上海证券交易所会员部:

章玲

联系电话: 021-68805896; 传真: 021-58878718

电子邮件: ygpeng@sse.com.cn。

池钺庭

联系电话: 021-68800040; 传真: 021-58878718

电子邮件: ctchi@sse.com.cn。

2. 上海证券交易所债券基金部:

袁伟荣

联系电话: 021-68802690; 传真: 021-68807177

电子邮件: wryuan@sse.com.cn

王风华

联系电话: 021-68804230; 传真: 021-68807177

电子邮件: fhwang@sse.com.cn

余力

联系电话: 021-68805249; 传真: 021-68807177

手机: 13501633446

电子邮件: Lshe@sse.com.cn

<msn:sheli7610@msn.com>

3、上海证券交易所技术支持方式

技术支持电话: (021)68644780 (交易日8:45-17:00)

技术支持email: tech_support@sse.com.cn

MSN群: <group410466@msnzone.cn>

文进炜

上海证券交易所技术规划与服务部

电话: 021-68828675

Email: jwwen@sse.com.cn & wenjinwei@gmail.com

4、上海证券通信有限责任公司运营保障部

联系人: 陈闽桂

电话: 021-58651522

手机: 18918500751